

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

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FAH1 CHF	34369449	CHF
GTH1 CHF	34369456	CHF
NTH1 CHF	34369457	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

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

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	70
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	70
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	71
7	Pauschale Verwaltungskommission	71
8	Benchmark	71
9	TER	71
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	72
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	72
12	Fussnoten	72
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	73
14	Pflichtpublikationen	75

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'080'699'926.95	912'525'561.84	1'691'575'967.18	1'771'911'176.16
Klasse FAH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		40'638'002.31	27'508'591.80	22'115'693.67	13'895'391.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		516'541.034	343'698.636	240'514.434	143'165.254
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		78.6733	80.0370	91.9516	97.0584
Ausschüttung je Anteil		1.75	1.70	1.80	1.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.23 %	0.23 %	0.23 %	0.23 %
Klasse GTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		93'468'158.76	83'068'432.89	680'359'951.01	781'457'826.23
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'091'881.700	967'927.202	7'001'751.518	7'712'196.046
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.6028	85.8210	97.1700	101.3275
Thesaurierung je Anteil		1.94	1.76	1.89	2.03
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		946'593'765.88	801'948'537.15	989'100'322.50	976'557'958.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'968'610.006	9'277'846.613	10'115'833.893	9'587'159.080
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		86.3002	86.4369	97.7774	101.8610
Thesaurierung je Anteil		2.08	1.90	2.05	2.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse (Lancierung 31.08.2022)	-	-	-	-
Klasse FAH1 CHF	0.41 %	2.01 %	-13.80 %	-2.72 %
Klasse GTH1 CHF	0.46 %	2.06 %	-13.75 %	-2.67 %
Klasse NTH1 CHF	0.61 %	2.22 %	-13.62 %	-2.52 %
Benchmark Hedge	0.94 %	2.49 %	-13.71 %	-
Benchmark	-	-	-	-2.49 %
Tracking Error 33)	0.14 %	0.16 %	0.35 %	0.07 %

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 FAH1 CHF	-0.53 %
Klasse GTH1 CHF	-0.48 %
Klasse NTH1 CHF	-0.33 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	30'611'975.08	28'758'546.44
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	604'854'927.79	497'390'778.82
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	451'066'415.74	384'097'894.54
Derivative Finanzinstrumente	-0.01	0.00
Sonstige Vermögenswerte	5'856'916.11	4'967'108.63
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'092'390'234.71	915'214'328.43
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-11'672'862.09	-2'675'776.25
Andere Verbindlichkeiten	-17'445.67	-12'990.34
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'080'699'926.95	912'525'561.84

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse	von bis	Lancierung	
		01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse FAH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		343'698.636	240'514.434
Ausgegebene Anteile		203'850.619	131'316.116
Zurückgenommene Anteile		-31'008.221	-28'131.914
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		516'541.034	343'698.636
Klasse GTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		967'927.202	7'001'751.518
Ausgegebene Anteile		456'698.241	1'707'428.784
Zurückgenommene Anteile		-332'743.743	-7'741'253.100
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'091'881.700	967'927.202
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'277'846.613	10'115'833.893
Ausgegebene Anteile		2'762'327.985	1'517'430.940
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		117'327.413	81'747.253
Zurückgenommene Anteile		-1'188'892.005	-2'437'165.473
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		10'968'610.006	9'277'846.613

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	31.03.2023	2'353'288.70	26'742.160
Klasse NTH1 CHF	31.03.2023	5'115'844.84	58'135.129
Klasse NTH1 CHF	31.03.2023	767'376.61	8'720.268
Klasse NTH1 CHF	30.06.2023	2'049'519.19	23'729.856

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		912'525'561.84	1'691'575'967.18
Ausbezahlte Ausschüttung		-656'720.19	-488'892.40
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-7'209'465.14	-10'744'491.89
Saldo aus dem Anteilverkehr		168'617'860.08	-599'173'630.98
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		7'422'690.25	-168'643'390.07
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'080'699'926.95	912'525'561.84

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		53'250.32	7'557.78
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-135'659.57	-258'597.69
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		13'021'917.55	15'690'432.64
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		10'724'615.08	14'103'266.54
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'685'233.38	3'449'394.07
Total Ertrag		28'349'356.76	32'992'053.34
Aufwand			
Passivzinsen		-90.52	-2'309.95
Reglementarische Vergütungen		-214'213.48	-886'575.87
Sonstige Aufwendungen		-84.00	-995.97
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'200'843.74	-12'135'421.24
Total Aufwand		-2'415'231.74	-13'025'303.03
Nettoertrag / Verlust		25'934'125.02	19'966'750.31
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		10'514'697.59	-95'430'669.61
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		203'527.53	0.00
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		607'058.19	804'940.34
Realisierter Erfolg		37'259'408.33	-74'658'978.96
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-29'836'718.08	-93'984'411.11
Gesamterfolg		7'422'690.25	-168'643'390.07

Verwendung des Erfolges

Klasse FAH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	909'193.90	563'753.01
Vortrag des Vorjahres	5'818.30	26'352.98
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	915'012.20	590'105.99
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	903'946.81	584'287.69
Vortrag auf neue Rechnung	11'065.39	5'818.30
Total	915'012.20	590'105.99

Klasse GTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	2'122'850.59	1'704'633.98
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'122'850.59	1'704'633.98
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	742'997.71	596'621.89
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'379'852.88	1'108'012.09
Total	2'122'850.59	1'704'633.98

Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	22'902'080.53	17'698'363.32
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	22'902'080.53	17'698'363.32
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	8'015'728.19	6'194'427.16
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	14'886'352.34	11'503'936.16
Total	22'902'080.53	17'698'363.32

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							733'154'481.24	67.11	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							604'854'927.79	55.37	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	610	200	70	740 AUD	92.38%	391'971.19	0.04	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	230	40	0	270 AUD	79.87%	123'649.79	0.01	a)
AU0000042004	2.5000 % TCV 2 1/2 10/22/29 MTN	200	0	0	200 AUD	91.09%	104'458.86	0.01	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	650	180	80	750 AUD	84.35%	362'745.48	0.03	a)
AU0000048274	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/34	110	120	0	230 AUD	77.57%	102'299.49	0.01	a)
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	610	160	0	770 AUD	80.47%	355'248.95	0.03	a)
AU0000078552	1.5000 % TCV 1 1/2 11/20/30	200	0	0	200 AUD	83.01%	95'187.47	0.01	a)
AU0000078644	3.0500 % EBIUH 3.05 02/26/30	0	30	0	30 AUD	87.81%	15'104.98	0.00	a)
AU0000079402	1.7500 % QTC 1 3/4 07/20/34	100	0	0	100 AUD	75.36%	43'209.17	0.00	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	710	50	660	100 AUD	97.33%	55'803.25	0.01	a)
AU0000085631	1.2500 % TCV 1 1/4 11/19/27 MTN	100	70	0	170 AUD	90.27%	87'990.76	0.01	a)
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	640	140	0	780 AUD	82.59%	369'343.82	0.03	a)
AU0000095457	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/25 161	670	110	0	780 AUD	94.16%	421'115.02	0.04	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	320	90	0	410 AUD	56.92%	133'803.83	0.01	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	670	200	0	870 AUD	80.06%	399'384.86	0.04	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	660	150	0	810 AUD	92.28%	428'575.82	0.04	a)
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	490	130	60	560 AUD	82.89%	266'133.19	0.02	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	340	90	0	430 AUD	90.98%	224'298.09	0.02	a)
AU0000249302	3.7500 % ACGB 3 3/4 05/21/34 167	250	120	0	370 AUD	96.71%	205'167.31	0.02	a)
AU0000274706	3.5000 % ACGB 3 1/2 12/21/34 168	0	380	0	380 AUD	94.20%	205'243.57	0.02	a)
AU0000300535	4.7500 % ACGB 4 3/4 06/21/54 169	0	150	0	150 AUD	104.31%	89'709.78	0.01	a)
AU0000XQLQJ5	6.5000 % QTC 6 1/2 03/14/33 33	80	0	0	80 AUD	113.84%	52'216.59	0.00	a)
AU0000XQLQU0	5.7500 % QTC 5 3/4 07/22/24 24	100	0	100	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000XQLQZ9	4.7500 % QTC 4 3/4 07/21/25 25	200	0	0	200 AUD	100.79%	115'578.80	0.01	a)
AU0000XVG2B1	5.5000 % TCV 5 1/2 12/17/24 1224	100	0	0	100 AUD	100.92%	57'865.09	0.01	a)
AU0000XVGH14	3.0000 % TCV 3 10/20/28 MTN	190	50	0	240 AUD	95.07%	130'827.47	0.01	a)
AU0000XVGZJ4	5.5000 % TCV 5 1/2 11/17/26	150	30	0	180 AUD	103.56%	106'877.68	0.01	a)
AU000KFVHAE5	3.2000 % KFW 3.2 09/11/26 MTN	30	40	0	70 AUD	97.47%	39'120.47	0.00	a)
AU000KFVHAG0	3.2000 % KFW 3.2 03/15/28 MTN	50	0	0	50 AUD	95.88%	27'486.50	0.00	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	367	170	0	537 AUD	102.90%	316'816.54	0.03	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	605	170	0	775 AUD	101.03%	448'956.55	0.04	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	160	150	0	310 AUD	87.09%	154'790.78	0.01	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	180	30	0	210 AUD	87.69%	105'583.13	0.01	a)
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	570	50	0	620 AUD	96.67%	343'662.35	0.03	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	500	190	0	690 AUD	94.28%	372'983.75	0.03	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	215	70	0	285 AUD	78.48%	128'251.09	0.01	a)
AU000XCLWAU3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	560	110	0	670 AUD	95.70%	367'635.35	0.03	a)
AU000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	570	140	0	710 AUD	94.47%	384'580.56	0.04	a)
AU000XQLQAA7	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/26 26	100	0	0	100 AUD	98.27%	56'345.08	0.01	a)
AU000XQLQAB5	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/28 28	90	70	0	160 AUD	96.79%	88'793.47	0.01	a)
AU3CB0214211	4.7500 % RENTEN 4 3/4 04/08/24 MTN	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0217826	5.2500 % KBN 5 1/4 07/15/24 MTN	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0218444	4.7500 % EIB 4 3/4 08/07/24 MTN	70	0	70	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0218691	4.7500 % IADB 4 3/4 08/27/24 MTN	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0221208	4.0000 % AUSCAP 4 05/22/24	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0222529	4.2500 % KBN 4 1/4 07/16/25 MTN	40	0	0	40 AUD	99.69%	22'863.02	0.00	a)
AU3CB0226801	3.4000 % NEDWBK 3.4 07/22/25 MTN	40	0	0	40 AUD	98.56%	22'604.09	0.00	a)
AU3CB0229227	2.7500 % IADB 2 3/4 10/30/25 MTN	50	0	0	50 AUD	97.50%	27'951.79	0.00	a)
AU3CB0230548	3.9000 % EUROF 3.9 12/19/25 MTN	50	0	0	50 AUD	98.99%	28'379.53	0.00	a)
AU3CB0237881	3.6000 % AAPL 3.6 06/10/26 MTN	40	0	0	40 AUD	98.20%	22'521.06	0.00	a)
AU3CB0239796	2.6000 % RENTEN 2.6 03/23/27 MTN	50	0	0	50 AUD	95.26%	27'308.76	0.00	a)
AU3CB0240133	2.5000 % IADB 2 1/2 04/14/27 MTN	50	0	0	50 AUD	94.87%	27'196.38	0.00	a)
AU3CB0242527	4.4000 % ANVAU 4.4 08/16/27 MTN	30	0	0	30 AUD	97.75%	16'813.39	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AU3CB0243566	4.5000 % WSOFIN 4 1/2 03/31/27 MTN	30	0	0	30 AUD	98.81%	16'996.75	0.00	a)
AU3CB0243806	3.2000 % IFC 3.2 10/18/27 MTN	80	0	0	80 AUD	96.34%	44'191.70	0.00	a)
AU3CB0244838	4.0000 % AZJAU 4 06/21/24 MTN	30	0	0	30 AUD	99.69%	17'146.92	0.00	a)
AU3CB0245884	3.3000 % EIB 3.3 02/03/28 MTN	40	0	0	40 AUD	96.35%	22'097.68	0.00	a)
AU3CB0246221	4.0500 % VZ 4.05 02/17/25 MTN	40	0	0	40 AUD	99.26%	22'764.17	0.00	a)
AU3CB0246239	4.5000 % VZ 4 1/2 08/17/27 MTN	100	0	0	100 AUD	98.75%	56'619.15	0.01	a)
AU3CB0246999	3.2500 % RENTEN 3 1/4 04/12/28 MTN	0	50	0	50 AUD	95.84%	27'475.90	0.00	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	140	0	0	140 AUD	95.58%	76'724.61	0.01	a)
AU3CB0248318	3.7500 % AUSGF 3 3/4 10/30/24 MTN	60	0	0	60 AUD	99.18%	34'121.14	0.00	a)
AU3CB0249373	4.2000 % VOD 4.2 12/13/27 MTN	50	0	0	50 AUD	97.03%	27'817.63	0.00	a)
AU3CB0249928	3.3000 % BNG 3.3 07/17/28 MTN	0	80	0	80 AUD	95.40%	43'760.07	0.00	a)
AU3CB0250132	3.4000 % KBN 3.4 07/24/28 MTN	60	0	0	60 AUD	95.55%	32'869.59	0.00	a)
AU3CB0250488	3.3500 % AFDB 3.35 08/08/28 MTN	180	0	0	180 AUD	95.25%	98'301.21	0.01	a)
AU3CB0250520	3.3000 % ASIA 3.3 08/08/28 MTN	100	0	0	100 AUD	95.69%	54'862.92	0.01	a)
AU3CB0250652	3.3000 % IBRD 3.3 08/14/28 MTN	60	0	0	60 AUD	95.85%	32'975.55	0.00	a)
AU3CB0250751	4.2000 % ANVAU 4.2 08/21/28 MTN	200	0	0	200 AUD	95.93%	110'005.65	0.01	a)
AU3CB0254910	3.1500 % IFC 3.15 06/26/29 MTN	70	0	0	70 AUD	93.81%	37'650.29	0.00	a)
AU3CB0257533	3.9000 % LOFINA 3.9 10/15/25 MTN	50	0	0	50 AUD	98.26%	28'169.67	0.00	a)
AU3CB0258135	3.3000 % NEDWBK 3.3 05/02/29 MTN	40	0	0	40 AUD	94.03%	21'564.68	0.00	a)
AU3CB0258739	2.9000 % IBRD 2.9 11/26/25 MTN	60	0	0	60 AUD	97.71%	33'614.74	0.00	a)
AU3CB0263945	1.7000 % EIB 1.7 11/15/24 MTN	70	0	0	70 AUD	98.12%	39'382.56	0.00	a)
AU3CB0265007	1.4500 % IFC 1.45 07/22/24	100	0	100	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0265239	1.5000 % KFW 1 1/2 07/24/24 MTN	100	0	100	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0265593	1.7500 % MQGAU 1 3/4 08/07/24 MTN	50	0	0	50 AUD	98.79%	28'320.47	0.00	a)
AU3CB0268548	2.4500 % LOFINA 2.45 11/20/26 MTN	0	50	0	50 AUD	93.55%	26'819.39	0.00	a)
AU3CB0271955	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/41 MTN	0	80	0	80 AUD	64.72%	29'686.35	0.00	a)
AU3CB0271989	2.2500 % QTC 2 1/4 11/20/41	0	60	0	60 AUD	65.80%	22'635.28	0.00	a)
AU3CB0272904	1.4100 % HOUAUS 1.41 06/29/32 MTN	100	0	0	100 AUD	78.54%	45'032.49	0.00	a)
AU3CB0273407	1.2000 % UBS 1.2 07/30/25	50	0	0	50 AUD	94.93%	27'215.87	0.00	a)
AU3CB0273563	1.8140 % AUSGF 1.814 02/05/27 MTN	50	0	0	50 AUD	90.92%	26'065.41	0.00	a)
AU3CB0276269	1.8152 % AGIF 1.8152 11/23/28 MTN	50	0	0	50 AUD	85.53%	24'519.89	0.00	a)
AU3CB0276509	1.0000 % NBNAUS 1 12/03/25 MTN	60	0	0	60 AUD	93.66%	32'219.73	0.00	a)
AU3CB0277077	0.7500 % EIB 0 3/4 07/15/27 MTN	0	40	0	40 AUD	89.07%	20'428.03	0.00	a)
AU3CB0283182	3.1500 % QANAU 3.15 09/27/28 MTN	0	30	0	30 AUD	90.45%	15'557.54	0.00	a)
AU3CB0284172	2.0000 % QTC 2 08/22/33	0	80	0	80 AUD	79.66%	36'538.81	0.00	a)
AU3CB0286763	2.9000 % NAB 2.9 02/25/27 MTN	100	0	0	100 AUD	95.06%	54'503.99	0.00	a)
AU3CB0286839	2.1500 % KFW 2.15 08/25/25 MTN	0	30	0	30 AUD	96.91%	16'668.73	0.00	a)
AU3CB0288397	4.2000 % NBNAUS 4.2 04/14/27 MTN	0	50	0	50 AUD	98.39%	28'206.08	0.00	a)
AU3CB0289817	3.9000 % NAB 3.9 05/30/25 MTN	100	0	0	100 AUD	99.14%	56'842.19	0.01	a)
AU3CB0291466	5.9060 % ANZ 5.906 08/12/32	100	0	0	100 AUD	101.39%	58'133.42	0.01	a)
AU3CB0291508	3.9000 % WSTP 3.9 08/11/25 MTN	100	0	0	100 AUD	99.00%	56'761.35	0.01	a)
AU3CB0291847	3.6000 % IFC 3.6 02/24/26 MTN	0	60	0	60 AUD	98.69%	33'952.91	0.00	a)
AU3CB0293751	5.3500 % ANZ 5.35 11/04/27 MTN	0	70	0	70 AUD	102.13%	40'991.21	0.00	a)
AU3CB0295541	4.3000 % KFW 4.3 07/13/27 MTN	0	30	0	30 AUD	100.00%	17'201.45	0.00	a)
AU3CB0296580	4.5000 % QTC 4 1/2 08/22/35	0	80	0	80 AUD	97.01%	44'498.11	0.00	a)
AU3CB0296598	4.2000 % KFW 4.2 02/08/29 MTN	0	20	0	20 AUD	99.12%	11'366.95	0.00	a)
AU3CB0296705	3.9000 % ASIA 3.9 02/17/26 MTN	0	60	0	60 AUD	99.25%	34'143.50	0.00	a)
AU3CB0296754	4.2000 % EIB 4.2 08/21/28	0	40	0	40 AUD	99.39%	22'794.21	0.00	a)
AU3CB0297018	6.1000 % EBIUH 6.1 02/21/33	0	30	0	30 AUD	103.37%	17'779.92	0.00	a)
AU3CB0297224	4.5000 % EDC 4 1/2 09/06/28	0	60	0	60 AUD	100.41%	34'543.26	0.00	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	0	50	0	50 AUD	99.50%	28'524.59	0.00	a)
AU3CB0297802	5.8020 % LLOYDS 5.802 03/17/29 MTN	0	70	0	70 AUD	101.37%	40'685.37	0.00	a)
AU3CB0298925	4.2000 % CPPIBC 4.2 05/02/28 MTN	0	100	0	100 AUD	98.95%	56'734.40	0.01	a)
AU3CB0300150	4.5000 % ASIA 4 1/2 06/20/30 MTN	0	50	0	50 AUD	99.33%	28'477.00	0.00	a)
AU3CB0300358	6.9340 % WSTP 6.934 06/23/38 MTN	0	100	0	100 AUD	106.28%	60'937.78	0.01	a)
AU3CB0303451	4.6000 % IFC 4.6 10/19/28	0	70	0	70 AUD	101.03%	40'550.11	0.00	a)
AU3SG0000417	5.0000 % NSWTC 5 08/20/24 24	150	0	150	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0001175	4.2500 % TCV 4 1/4 12/20/32	200	80	0	280 AUD	96.71%	155'255.33	0.01	a)
AU3SG0001241	5.0000 % WATC 5 07/23/25 25	100	0	0	100 AUD	101.12%	57'980.91	0.01	a)
AU3SG0001373	4.0000 % NSWTC 4 05/20/26 26	100	0	0	100 AUD	99.95%	57'306.62	0.01	a)
AU3SG0001464	3.2500 % TASCOR 3 1/4 02/19/26 26	200	0	0	200 AUD	98.46%	112'911.49	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AU3SG0001498	3.0000 % SAFA 3 07/20/26 26	50	0	0	50 AUD	97.69%	28'005.40	0.00	a)
AU3SG0001514	3.0000 % NSWTC 3 03/20/28	210	0	0	210 AUD	96.08%	115'685.34	0.01	a)
AU3SG0001555	2.5000 % AUSCAP 2 1/2 05/21/26 MTN	50	0	0	50 AUD	96.64%	27'704.10	0.00	a)
AU3SG0001563	3.0000 % WATC 3 10/21/27 27	50	0	0	50 AUD	96.57%	27'684.60	0.00	a)
AU3SG0001571	3.0000 % NSWTC 3 02/20/30	300	0	0	300 AUD	93.31%	160'500.06	0.01	a)
AU3SG0001605	2.7500 % QTC 2 3/4 08/20/27 27	210	0	0	210 AUD	95.93%	115'510.75	0.01	a)
AU3SG0001621	2.2500 % SAFA 2 1/4 08/15/24 24	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0001639	2.5000 % WATC 2 1/2 07/23/24 24	60	0	60	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0001688	3.0000 % SAFA 3 09/20/27 27	50	0	0	50 AUD	96.58%	27'689.19	0.00	a)
AU3SG0001696	3.0000 % NSWTC 3 05/20/27 27	170	60	0	230 AUD	96.96%	127'870.08	0.01	a)
AU3SG0001704	3.0000 % WATC 3 10/21/26 26	100	0	0	100 AUD	97.49%	55'899.57	0.01	a)
AU3SG0001720	3.0000 % NSWTC 3 04/20/29 29	200	0	0	200 AUD	94.69%	108'584.84	0.01	a)
AU3SG0001753	3.5000 % NSWTC 3 1/2 11/20/37 37	0	30	0	30 AUD	84.84%	14'593.76	0.00	a)
AU3SG0001829	3.2500 % WATC 3 1/4 07/20/28 28	70	50	0	120 AUD	96.81%	66'607.49	0.01	a)
AU3SG0001837	3.0000 % SAFA 3 05/24/28 28	150	0	0	150 AUD	95.86%	82'446.61	0.01	a)
AU3SG0001860	3.2500 % QTC 3 1/4 08/21/29	100	60	0	160 AUD	95.56%	87'666.00	0.01	a)
AU3SG0001878	3.0000 % NSWTC 3 11/15/28	50	0	0	50 AUD	95.39%	27'348.04	0.00	a)
AU3SG0001910	2.7500 % WATC 2 3/4 07/24/29 29	50	0	0	50 AUD	93.26%	26'736.25	0.00	a)
AU3SG0001928	2.5000 % QTC 2 1/2 03/06/29	50	0	0	50 AUD	92.74%	26'587.46	0.00	a)
AU3SG0001944	2.0000 % NSWTC 2 03/20/31	240	0	0	240 AUD	85.43%	117'557.85	0.01	a)
AU3SG0001951	2.0000 % NTTC 2 05/21/29	0	100	0	100 AUD	89.37%	51'241.52	0.00	a)
AU3SG0001969	1.2500 % AUSCAP 1 1/4 05/22/25	50	0	0	50 AUD	96.50%	27'664.54	0.00	a)
AU3SG0001993	1.7500 % QTC 1 3/4 08/21/31	200	0	0	200 AUD	83.14%	95'344.57	0.01	a)
AU3SG0002025	1.2500 % NSWTC 1 1/4 03/20/25	0	40	0	40 AUD	97.01%	22'249.51	0.00	a)
AU3SG0002058	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/32	200	0	0	200 AUD	80.63%	92'457.08	0.01	a)
AU3SG0002082	2.0000 % NSWTC 2 03/08/33	100	150	0	250 AUD	80.37%	115'200.09	0.01	a)
AU3SG0002124	2.2500 % QTC 2 1/4 04/16/40	50	0	0	50 AUD	67.91%	19'469.36	0.00	a)
AU3SG0002165	2.2500 % NSWTC 2 1/4 05/07/41	50	0	0	50 AUD	66.23%	18'988.30	0.00	a)
AU3SG0002249	2.2500 % NSWTC 2 1/4 11/20/40	0	50	0	50 AUD	66.82%	19'155.15	0.00	a)
AU3SG0002256	2.0000 % TCV 2 11/20/37 MTN	0	70	0	70 AUD	68.54%	27'509.15	0.00	a)
AU3SG0002298	2.2500 % SAFA 2 1/4 05/24/40	50	0	0	50 AUD	66.48%	19'059.11	0.00	a)
AU3SG0002314	1.5000 % TCV 1 1/2 09/10/31 MTN	200	80	0	280 AUD	80.59%	129'383.72	0.01	a)
AU3SG0002371	1.2500 % QTC 1 1/4 03/10/31	50	0	0	50 AUD	81.27%	23'297.75	0.00	a)
AU3SG0002389	1.5000 % NSWTC 1 1/2 02/20/32	100	170	0	270 AUD	79.69%	123'372.68	0.01	a)
AU3SG0002421	0.5000 % TCV 0 1/2 11/20/25 MTN	200	0	0	200 AUD	94.00%	107'794.73	0.01	a)
AU3SG0002439	1.5000 % QTC 1 1/2 08/20/32	100	70	0	170 AUD	78.68%	76'690.72	0.01	a)
AU3SG0002454	1.5000 % WATC 1 1/2 10/22/30	130	0	0	130 AUD	84.03%	62'631.40	0.01	a)
AU3SG0002470	2.5000 % NTTC 2 1/2 05/21/32	0	100	0	100 AUD	84.80%	48'623.51	0.00	a)
AU3SG0002504	2.2500 % TCV 2 1/4 09/15/33	0	230	0	230 AUD	80.40%	106'028.92	0.01	a)
AU3SG0002520	2.0000 % SAFA 2 05/23/36	0	50	0	50 AUD	72.28%	20'722.17	0.00	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	0	200	0	200 AUD	75.84%	86'972.22	0.01	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	0	120	0	120 AUD	73.52%	50'583.63	0.00	a)
AU3SG0002603	2.5000 % TASCOR 2 1/2 01/21/33 MTN	0	50	0	50 AUD	84.28%	24'161.82	0.00	a)
AU3SG0002611	2.5000 % AUSCAP 2 1/2 10/22/32 MTN	0	50	0	50 AUD	84.87%	24'329.81	0.00	a)
AU3SG0002629	2.5000 % NSWTC 2 1/2 11/22/32	0	60	0	60 AUD	85.00%	29'241.19	0.00	a)
AU3SG0002702	4.7500 % NSWTC 4 3/4 02/20/35	0	200	0	200 AUD	99.01%	113'536.46	0.01	a)
AU3SG0002710	4.7500 % TCV 4 3/4 09/15/36 MTN	0	190	0	190 AUD	96.82%	105'476.02	0.01	a)
AU3SG0002728	4.2500 % NSWTC 4 1/4 02/20/36	0	120	0	120 AUD	93.55%	64'367.22	0.01	a)
AU3SG0002769	4.5000 % AUSCAP 4 1/2 10/23/34	0	40	0	40 AUD	97.68%	22'401.80	0.00	a)
AU3SG0002793	4.2500 % WATC 4 1/4 07/20/33	0	100	0	100 AUD	97.51%	55'908.17	0.01	a)
AU3SG0002850	4.7500 % TASCOR 4 3/4 01/21/31 MTN	0	50	0	50 AUD	102.05%	29'254.78	0.00	a)
AU3SG0002868	5.2500 % QTC 5 1/4 07/21/36	0	30	0	30 AUD	103.03%	17'722.13	0.00	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	575	220	50	745 AUD	103.05%	440'197.69	0.04	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	580	0	580	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	580	200	60	720 AUD	97.49%	402'476.93	0.04	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	665	120	50	735 AUD	99.22%	418'135.70	0.04	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	205	60	0	265 AUD	94.82%	144'072.43	0.01	a)
AUD							14'836'756.04	1.36	
CA007863AC74	6.5500 % AERMON 6.55 10/11/33	50	0	0	50 CAD	113.54%	36'855.40	0.00	a)
CA00889YAD37	2.7120 % AIREIN 2.712 06/01/29 4	50	0	0	50 CAD	91.04%	29'553.14	0.00	a)
CA013051DK06	3.4500 % ALTA 3.45 12/01/43	100	0	0	100 CAD	87.22%	56'621.11	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA013051DQ75	2.3500 % ALTA 2.35 06/01/25	100	0	0	100 CAD	97.31%	63'176.14	0.01	a)
CA013051DT15	2.2000 % ALTA 2.2 06/01/26	50	0	0	50 CAD	95.68%	31'056.70	0.00	a)
CA013051DW44	2.5500 % ALTA 2.55 06/01/27	120	0	0	120 CAD	95.53%	74'423.11	0.01	a)
CA013051DY00	3.0500 % ALTA 3.05 12/01/48	190	0	0	190 CAD	79.80%	98'435.02	0.01	a)
CA013051EB97	2.9000 % ALTA 2.9 12/01/28	40	0	0	40 CAD	95.51%	24'800.95	0.00	a)
CA013051ED53	3.1000 % ALTA 3.1 06/01/50	200	0	0	200 CAD	80.48%	104'498.73	0.01	a)
CA013051EG84	2.0500 % ALTA 2.05 06/01/30	200	0	0	200 CAD	89.39%	116'070.17	0.01	a)
CA013051EP83	1.6500 % ALTA 1.65 06/01/31	0	70	0	70 CAD	85.15%	38'697.26	0.00	a)
CA013051EQ66	2.9500 % ALTA 2.95 06/01/52	0	50	0	50 CAD	78.08%	25'344.66	0.00	a)
CA013051ER40	4.1500 % ALTA 4.15 06/01/33	0	30	0	30 CAD	99.95%	19'465.85	0.00	a)
CA01306ZCV19	2.9000 % ALTA 2.9 09/20/29 MTN	50	0	0	50 CAD	94.81%	30'775.92	0.00	a)
CA01306ZDC29	3.9000 % ALTA 3.9 12/01/33 MTN	40	0	0	40 CAD	97.80%	25'396.40	0.00	a)
CA014443AL94	1.7510 % ALCTRA 1.751 02/11/31	0	40	0	40 CAD	84.62%	21'974.05	0.00	a)
CA014443AM77	5.2250 % ALCTRA 5.225 11/14/52	0	40	0	40 CAD	108.62%	28'207.46	0.00	a)
CA01626PAE66	3.6000 % ATDBCN 3.6 06/02/25 5	100	0	0	100 CAD	98.25%	63'781.85	0.01	a)
CA019456AG78	3.1310 % APUCN 3.131 05/15/28 G	50	0	0	50 CAD	88.10%	28'598.48	0.00	a)
CA02135ZAE66	4.4620 % ALTALK 4.462 11/08/41 MTN	50	0	0	50 CAD	97.00%	31'486.47	0.00	a)
CA02138ZAH60	4.4000 % ALACN 4.4 03/15/24 MTN	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA02138ZAQ69	3.9800 % ALACN 3.98 10/04/27 MTN	50	0	0	50 CAD	97.47%	31'638.71	0.00	a)
CA045167FD06	1.5000 % ASIA 1 1/2 05/04/28	0	40	0	40 CAD	90.65%	23'539.42	0.00	a)
CA045167FY43	4.4000 % ASIA 4.4 07/13/26 GMTN	0	40	0	40 CAD	100.30%	26'045.87	0.00	a)
CA060505FZ26	1.9780 % BAC 1.978 09/15/27 MPLE	0	60	0	60 CAD	92.99%	36'223.33	0.00	a)
CA060505GF52	3.6150 % BAC 3.615 03/16/28	0	60	0	60 CAD	96.38%	37'541.87	0.00	a)
CA06368AAA84	2.7000 % BMO 2.7 12/09/26 DPNT	50	0	0	50 CAD	95.47%	30'988.21	0.00	a)
CA06368AAD24	2.7000 % BMO 2.7 09/11/24 DPNT	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA06368BTX69	3.1900 % BMO 3.19 03/01/28 DPNT	150	0	0	150 CAD	95.72%	93'209.04	0.01	a)
CA06368D3U60	4.3090 % BMO 4.309 06/01/27	0	100	0	100 CAD	98.87%	64'186.31	0.01	a)
CA06368LB887	4.5370 % BMO 4.537 12/18/28	0	70	0	70 CAD	99.26%	45'106.74	0.00	a)
CA06369ZCF95	2.0770 % BMO 2.077 06/17/30	50	0	0	50 CAD	96.05%	31'178.75	0.00	a)
CA06369ZCG78	1.9280 % BMO 1.928 07/22/31	100	0	0	100 CAD	93.02%	60'390.40	0.01	a)
CA064151QE68	2.6200 % BNS 2.62 12/02/26 DPNT	50	0	0	50 CAD	95.27%	30'925.56	0.00	a)
CA064151S959	3.1000 % BNS 3.1 02/02/28 DPNT	100	0	0	100 CAD	95.44%	61'958.23	0.01	a)
CA064151WY58	2.2900 % BNS 2.29 06/28/24 DPNT	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA064151EUC79	2.8360 % BNS 2.836 07/03/29	70	0	70	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA064151EV939	2.1600 % BNS 2.16 02/03/25	70	0	0	70 CAD	97.39%	44'259.20	0.00	a)
CA064151GDE76	2.9500 % BNS 2.95 03/08/27	0	60	0	60 CAD	95.16%	37'067.04	0.00	a)
CA064151GH297	5.5000 % BNS 5 1/2 05/08/26	0	70	0	70 CAD	101.33%	46'046.98	0.00	a)
CA07329VAR11	3.0000 % BCIMCR 3 03/31/27 MTN	100	0	0	100 CAD	95.58%	62'049.12	0.01	a)
CA07813ZAT18	6.1000 % BCECN 6.1 03/16/35 MTN	50	0	0	50 CAD	107.61%	34'929.53	0.00	a)
CA07813ZBR43	4.3500 % BCECN 4.35 12/18/45 MTN	50	0	0	50 CAD	87.89%	28'528.37	0.00	a)
CA07813ZBT09	3.5500 % BCECN 3.55 03/02/26 MTN	50	0	0	50 CAD	97.61%	31'684.15	0.00	a)
CA07813ZBY93	3.6000 % BCECN 3.6 09/29/27 MTN	50	0	0	50 CAD	96.72%	31'394.61	0.00	a)
CA07813ZCA09	3.8000 % BCECN 3.8 08/21/28 MTN	100	0	0	100 CAD	96.70%	62'780.78	0.01	a)
CA07813ZCD48	3.5000 % BCECN 3 1/2 09/30/50	0	50	0	50 CAD	75.02%	24'352.68	0.00	a)
CA07813ZCL63	4.5500 % BCECN 4.55 02/09/30	0	50	0	50 CAD	98.93%	32'112.31	0.00	a)
CA110574AK68	2.7940 % BCFERR 2.794 10/15/49 191	60	0	0	60 CAD	72.63%	28'289.13	0.00	a)
CA1107098Y17	4.3000 % BRCOL 4.3 06/18/42	100	0	0	100 CAD	99.03%	64'292.78	0.01	a)
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	0	60	0	60 CAD	75.46%	29'393.82	0.00	a)
CA110709EK47	5.7000 % BRCOL 5.7 06/18/29	40	0	0	40 CAD	108.29%	28'121.77	0.00	a)
CA110709EX67	6.3500 % BRCOL 6.35 06/18/31	80	0	0	80 CAD	114.41%	59'421.53	0.01	a)
CA110709FL11	4.7000 % BRCOL 4.7 06/18/37	60	0	0	60 CAD	103.95%	40'490.95	0.00	a)
CA110709FY32	4.9500 % BRCOL 4.95 06/18/40 BCCD	30	0	0	30 CAD	106.99%	20'836.58	0.00	a)
CA110709GC03	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/44	100	0	0	100 CAD	84.22%	54'676.09	0.01	a)
CA110709GH99	2.9500 % BRCOL 2.95 12/18/28	0	60	0	60 CAD	95.73%	37'288.68	0.00	a)
CA110709GJ55	2.9500 % BRCOL 2.95 06/18/50	130	0	0	130 CAD	78.76%	66'473.39	0.01	a)
CA110709GK29	2.2000 % BRCOL 2.2 06/18/30	90	0	0	90 CAD	90.14%	52'666.87	0.00	a)
CA110709GL02	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/32	0	70	0	70 CAD	93.65%	42'560.04	0.00	a)
CA110709GM84	4.2500 % BRCOL 4 1/4 12/18/53	0	70	0	70 CAD	100.14%	45'506.20	0.00	a)
CA11070TAF53	2.8500 % BRCOL 2.85 06/18/25	70	0	0	70 CAD	97.86%	44'469.61	0.00	a)
CA11070TAG37	2.8000 % BRCOL 2.8 06/18/48	120	0	0	120 CAD	76.90%	59'910.25	0.01	a)
CA11070TAL22	2.5500 % BRCOL 2.55 06/18/27	100	0	0	100 CAD	95.52%	62'014.71	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA11257ZAF68	3.8000 % BNCN 3.8 03/16/27 MTN	100	0	0	100 CAD	97.64%	63'388.43	0.01	a)
CA11282ZAL28	3.6300 % BAMREP 3.63 01/15/27 MTN	100	0	0	100 CAD	96.97%	62'956.06	0.01	a)
CA11291ZAD92	3.3150 % BIP 3.315 02/22/24 MTN	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA11291ZAM91	5.7100 % BIP 5.71 07/27/30	0	60	0	60 CAD	103.53%	40'326.96	0.00	a)
CA116705AB01	3.9690 % BRUPOW 3.969 06/23/26	100	0	0	100 CAD	98.23%	63'768.87	0.01	a)
CA125491AJ93	3.7590 % CIXCN 3.759 05/26/25	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA12593CAF82	3.0000 % CPPIBC 3 06/15/28 EMTN	0	250	0	250 CAD	96.26%	156'234.57	0.01	a)
CA126462AF74	3.8650 % CRTUCN 3.865 12/07/27 F	60	0	0	60 CAD	95.94%	37'371.65	0.00	a)
CA12657ZBE21	4.0850 % CUCN 4.085 09/02/44	40	50	0	90 CAD	91.86%	53'672.42	0.00	a)
CA12657ZBM47	2.9630 % CUCN 2.963 09/07/49	120	0	0	120 CAD	74.64%	58'146.49	0.01	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	450	0	450	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	152	30	0	182 CAD	87.73%	103'657.75	0.01	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	235	60	0	295 CAD	89.27%	170'971.77	0.02	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	188	0	0	188 CAD	97.36%	118'826.07	0.01	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	210	50	0	260 CAD	94.66%	159'774.82	0.01	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	250	0	0	250 CAD	91.88%	149'125.77	0.01	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	220	50	0	270 CAD	93.86%	164'519.47	0.02	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	890	180	0	1'070 CAD	75.25%	522'751.90	0.05	a)
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	170	100	0	270 CAD	94.10%	164'947.17	0.02	a)
CA135087J546	2.2500 % CAN 2 1/4 03/01/24	200	0	200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087J967	1.5000 % CAN 1 1/2 09/01/24	320	0	320	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	750	120	0	870 CAD	87.46%	493'959.24	0.05	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	340	0	0	340 CAD	96.82%	213'717.31	0.02	a)
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	930	0	0	930 CAD	94.51%	570'620.75	0.05	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	670	150	0	820 CAD	82.18%	437'468.10	0.04	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	530	160	0	690 CAD	92.74%	415'417.11	0.04	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	660	0	660	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L930	1.0000 % CAN 1 09/01/26	410	50	0	460 CAD	93.11%	278'055.66	0.03	a)
CA135087M276	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/31	680	140	0	820 CAD	87.23%	464'341.05	0.04	a)
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	200	0	200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	510	120	0	630 CAD	69.99%	286'250.59	0.03	a)
CA135087M847	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/27	150	150	0	300 CAD	92.90%	180'937.49	0.02	a)
CA135087M920	0.7500 % CAN 0 3/4 02/01/24	240	0	240	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	530	140	0	670 CAD	86.46%	376'077.46	0.03	a)
CA135087N340	1.5000 % CAN 1 1/2 04/01/25	0	100	0	100 CAD	96.78%	62'831.42	0.01	a)
CA135087N423	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/24	80	0	80	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	400	90	0	490 CAD	89.27%	283'977.46	0.03	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	60	30	0	90 CAD	93.71%	54'755.10	0.01	a)
CA135087N837	2.7500 % CAN 2 3/4 09/01/27	280	50	0	330 CAD	96.90%	207'602.90	0.02	a)
CA135087N910	2.7500 % CAN 2 3/4 08/01/24	220	0	220	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P246	3.0000 % CAN 3 10/01/25	140	0	0	140 CAD	97.94%	89'020.11	0.01	a)
CA135087P329	2.5000 % CAN 2 1/2 12/01/32	340	80	0	420 CAD	92.46%	252'112.76	0.02	a)
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	260	0	0	260 CAD	98.82%	166'801.69	0.02	a)
CA135087P576	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/28	190	130	0	320 CAD	99.46%	206'626.04	0.02	a)
CA135087P659	3.7500 % CAN 3 3/4 02/01/25	200	0	0	200 CAD	99.17%	128'763.44	0.01	a)
CA135087P816	3.0000 % CAN 3 04/01/26	40	170	0	210 CAD	97.86%	133'415.64	0.01	a)
CA135087P998	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/55	30	200	0	230 CAD	88.44%	132'053.22	0.01	a)
CA135087Q236	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/33	0	400	0	400 CAD	94.16%	244'503.81	0.02	a)
CA135087Q319	3.7500 % CAN 3 3/4 05/01/25	0	250	0	250 CAD	99.11%	160'861.78	0.01	a)
CA135087Q491	3.2500 % CAN 3 1/4 09/01/28	0	400	0	400 CAD	98.54%	255'877.89	0.02	a)
CA135087Q640	3.5000 % CAN 3 1/2 08/01/25	0	490	0	490 CAD	98.74%	314'099.36	0.03	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	0	410	0	410 CAD	98.06%	261'021.16	0.02	a)
CA135087Q806	4.5000 % CAN 4 1/2 11/01/25	0	400	0	400 CAD	100.28%	260'417.14	0.02	a)
CA135087Q988	4.0000 % CAN 4 03/01/29	0	230	0	230 CAD	101.93%	152'203.59	0.01	a)
CA135087R226	4.5000 % CAN 4 1/2 02/01/26	0	320	0	320 CAD	100.58%	208'942.40	0.02	a)
CA135087R481	3.0000 % CAN 3 06/01/34	0	80	0	80 CAD	95.85%	49'782.64	0.00	a)
CA135087VH40	9.0000 % CAN 9 06/01/25 A76	150	0	0	150 CAD	105.41%	102'650.12	0.01	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	155	0	0	155 CAD	113.02%	113'728.48	0.01	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	230	0	0	230 CAD	110.58%	165'121.03	0.02	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	200	40	0	240 CAD	117.34%	182'829.80	0.02	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	185	60	0	245 CAD	115.88%	184'310.18	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	233	60	0	293 CAD	106.87%	203'275.65	0.02	a)
CA135087Z568	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	267	50	0	317 CAD	101.02%	207'899.37	0.02	a)
CA13509PEF68	2.9000 % CANHOU 2.9 06/15/24	215	0	215	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13509PER07	2.5500 % CANHOU 2.55 03/15/25	60	0	0	60 CAD	97.91%	38'139.40	0.00	a)
CA13509PFA62	1.9500 % CANHOU 1.95 12/15/25	250	0	0	250 CAD	95.92%	155'679.50	0.01	a)
CA13509PFD02	2.2500 % CANHOU 2 1/4 12/15/25	50	0	0	50 CAD	96.43%	31'301.77	0.00	a)
CA13509PFL28	1.9000 % CANHOU 1.9 09/15/26	60	60	0	120 CAD	94.75%	73'810.78	0.01	a)
CA13509PFX65	2.3500 % CANHOU 2.35 06/15/27	200	0	0	200 CAD	95.08%	123'446.44	0.01	a)
CA13509PGF41	2.3500 % CANHOU 2.35 03/15/28	100	0	0	100 CAD	94.43%	61'301.24	0.01	a)
CA13509PGL19	2.6500 % CANHOU 2.65 03/15/28 FEB	60	0	0	60 CAD	95.53%	37'211.56	0.00	a)
CA13509PGS61	2.6500 % CANHOU 2.65 12/15/28	120	0	0	120 CAD	95.00%	74'005.54	0.01	a)
CA13509PHD83	2.1000 % CANHOU 2.1 09/15/29	130	0	0	130 CAD	91.63%	77'336.10	0.01	a)
CA13509PHJ53	1.8000 % CANHOU 1.8 12/15/24	200	0	0	200 CAD	97.73%	126'896.32	0.01	a)
CA13509PHM82	1.7500 % CANHOU 1 3/4 06/15/30	120	60	0	180 CAD	88.61%	103'545.82	0.01	a)
CA13509PHN65	0.9500 % CANHOU 0.95 06/15/25 MAR	200	0	0	200 CAD	95.56%	124'076.17	0.01	a)
CA13509PHQ96	1.1000 % CANHOU 1.1 03/15/31	60	0	0	60 CAD	83.39%	32'481.96	0.00	a)
CA13509PHS52	1.4000 % CANHOU 1.4 03/15/31	100	0	0	100 CAD	85.22%	55'327.25	0.01	a)
CA13509PHT36	1.2500 % CANHOU 1 1/4 06/15/26	200	0	0	200 CAD	93.67%	121'627.37	0.01	a)
CA13509PHU09	1.9000 % CANHOU 1.9 03/15/31 100	40	40	0	80 CAD	88.28%	45'849.50	0.00	a)
CA13509PHW64	1.6000 % CANHOU 1.6 12/15/31 101	150	0	0	150 CAD	85.09%	82'861.36	0.01	a)
CA13509PHX48	1.1000 % CANHOU 1.1 12/15/26	200	0	0	200 CAD	92.29%	119'831.67	0.01	a)
CA13509PHZ95	2.1500 % CANHOU 2.15 12/15/31 104	0	40	0	40 CAD	88.76%	23'049.14	0.00	a)
CA13509PJB00	2.4500 % CANHOU 2.45 12/15/31	50	0	0	50 CAD	90.80%	29'472.64	0.00	a)
CA13509PJC82	3.5500 % CANHOU 3.55 09/15/32	170	40	0	210 CAD	97.80%	133'333.84	0.01	a)
CA13509PJE49	3.8000 % CANHOU 3.8 06/15/27	170	0	0	170 CAD	99.49%	109'805.40	0.01	a)
CA13509PJF14	3.6000 % CANHOU 3.6 12/15/27	50	100	0	150 CAD	98.96%	96'369.05	0.01	a)
CA13509PJK09	3.6500 % CANHOU 3.65 06/15/33	0	190	0	190 CAD	98.25%	121'192.92	0.01	a)
CA13509PJL81	3.1000 % CANHOU 3.1 06/15/28	0	80	0	80 CAD	97.09%	50'422.50	0.00	a)
CA13509PJN48	3.9500 % CANHOU 3.95 06/15/28	0	90	0	90 CAD	100.41%	58'669.23	0.01	a)
CA13509PJP95	4.1500 % CANHOU 4.15 06/15/33	0	90	0	90 CAD	102.11%	59'659.59	0.01	a)
CA13509Pjq78	4.2500 % CANHOU 4 1/4 12/15/28	0	210	0	210 CAD	101.88%	138'900.33	0.01	a)
CA13509PJS35	4.2500 % CANHOU 4 1/4 03/15/34	0	150	0	150 CAD	102.98%	100'281.81	0.01	a)
CA13596Z3Y90	3.3000 % CM 3.3 05/26/25 DPNT	50	0	0	50 CAD	98.09%	31'839.96	0.00	a)
CA13607GCJ19	2.9500 % CM 2.95 06/19/29	70	0	70	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607H5C22	5.0500 % CM 5.05 10/07/27	0	50	0	50 CAD	101.02%	32'791.05	0.00	a)
CA13607HK276	2.7500 % CM 2 3/4 03/07/25	100	0	0	100 CAD	97.74%	63'455.95	0.01	a)
CA13607HR792	4.2000 % CM 4.2 04/07/32	0	50	0	50 CAD	97.31%	31'587.42	0.00	a)
CA13607HRJ37	1.9600 % CM 1.96 04/21/31	40	0	0	40 CAD	93.62%	24'311.97	0.00	a)
CA13607HV661	4.9500 % CM 4.95 06/29/27	0	100	0	100 CAD	100.66%	65'346.44	0.01	a)
CA13607HVV19	1.7000 % CM 1.7 07/15/26	100	0	0	100 CAD	93.66%	60'802.65	0.01	a)
CA136375CF77	2.8000 % CNRCN 2.8 09/22/25	100	0	0	100 CAD	96.98%	62'958.66	0.01	a)
CA13638ZDD48	4.8500 % CNQCN 4.85 05/30/47 MTN	50	0	0	50 CAD	92.59%	30'055.62	0.00	a)
CA136765BU77	5.1460 % CWBCN 5.146 09/02/27 DPNT	0	60	0	60 CAD	100.67%	39'214.48	0.00	a)
CA17039AAN69	4.1780 % CHPUCN 4.178 03/08/28 L	60	0	0	60 CAD	97.81%	38'100.84	0.00	a)
CA17039AAY25	5.6990 % CHPUCN 5.699 02/28/34	0	60	0	60 CAD	103.14%	40'175.44	0.00	a)
CA227107AT67	5.2440 % CRRUCN 5.244 09/28/29	0	50	0	50 CAD	100.16%	32'512.54	0.00	a)
CA233852AD45	2.1400 % DTRGR 2.14 12/13/24	50	0	0	50 CAD	97.69%	31'708.82	0.00	a)
CA254687FU53	3.0570 % DIS 3.057 03/30/27 MPLE	100	0	0	100 CAD	95.95%	62'290.63	0.01	a)
CA25675TAP27	5.1650 % DOLCN 5.165 04/26/30	0	50	0	50 CAD	102.22%	33'181.55	0.00	a)
CA29250ZAX65	3.5200 % ENBPIP 3.52 02/22/29 MTN	50	0	0	50 CAD	94.85%	30'788.58	0.00	a)
CA29250ZAY49	4.3300 % ENBPIP 4.33 02/22/49 MTN	70	0	0	70 CAD	85.21%	38'722.26	0.00	a)
CA29251ZBG15	4.5700 % ENBCN 4.57 03/11/44 MTN	40	0	0	40 CAD	88.81%	23'062.12	0.00	a)
CA29251ZBK27	3.2000 % ENBCN 3.2 06/08/27 MTN	0	50	0	50 CAD	95.53%	31'008.33	0.00	a)
CA29251ZBQ96	3.9500 % ENBCN 3.95 11/19/24 MTN	60	0	0	60 CAD	99.14%	38'615.79	0.00	a)
CA29251ZBR79	4.8700 % ENBCN 4.87 11/21/44 MTN	50	0	0	50 CAD	92.31%	29'965.06	0.00	a)
CA29251ZBW64	6.1000 % ENBCN 6.1 11/09/32	0	50	0	50 CAD	107.10%	34'766.26	0.00	a)
CA29260ZAK27	5.6700 % ENBGAS 5.67 10/06/53	0	60	0	60 CAD	114.37%	44'549.40	0.00	a)
CA29290ZAR16	2.5000 % ENBGAS 2 1/2 08/05/26 MTN	50	0	0	50 CAD	95.16%	30'889.53	0.00	a)
CA29410ZAP05	3.1060 % EPCOR 3.106 07/08/49 MTN	50	0	0	50 CAD	76.69%	24'894.44	0.00	a)
CA303901AW28	4.9500 % FFHCN 4.95 03/03/25	50	0	0	50 CAD	100.00%	32'460.28	0.00	a)
CA303901AZ58	4.2500 % FFHCN 4 1/4 12/06/27	40	0	0	40 CAD	97.60%	25'343.69	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA31430WDW16	2.8560 % CCDJ 2.856 05/26/30	50	0	0	50 CAD	97.11%	31'520.55	0.00	a)
CA31430WF908	5.4670 % CCDJ 5.467 11/17/28	0	40	0	40 CAD	102.95%	26'734.29	0.00	a)
CA31430WFL33	1.0930 % CCDJ 1.093 01/21/26	100	0	0	100 CAD	93.60%	60'768.24	0.01	a)
CA31739ZAG06	5.2500 % FINQUE 5 1/4 06/01/34	40	0	0	40 CAD	108.14%	28'082.82	0.00	a)
CA31943BBV14	4.7900 % FCRCN 4.79 08/30/24 R	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA349553AR86	5.6770 % FTSCN 5.677 11/08/33	0	50	0	50 CAD	106.31%	34'509.50	0.00	a)
CA34959ZAH51	3.8500 % FTSCN 3.85 12/07/48 MTN	60	0	0	60 CAD	87.76%	34'186.13	0.00	a)
CA35085ZAM82	5.7500 % ETRHWY 5 3/4 02/14/36 06D1	40	0	0	40 CAD	106.36%	27'619.28	0.00	a)
CA35085ZBS44	3.7200 % ETRHWY 3.72 05/11/48 MTN	60	0	0	60 CAD	85.63%	33'356.05	0.00	a)
CA35085ZBT27	3.1400 % ETRHWY 3.14 03/06/30 MTN	50	0	0	50 CAD	94.08%	30'538.96	0.00	a)
CA35085ZBU99	3.6700 % ETRHWY 3.67 03/08/49 MTN	50	0	0	50 CAD	84.67%	27'483.47	0.00	a)
CA38141GWR15	3.3070 % GS 3.307 10/31/25 MPLE	60	0	60	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA39138CAH93	3.3370 % GWOCN 3.337 02/28/28	60	0	0	60 CAD	96.19%	37'466.69	0.00	a)
CA39138CAJ59	2.9810 % GWOCN 2.981 07/08/50	0	50	0	50 CAD	73.86%	23'974.51	0.00	a)
CA39138CAK23	2.3790 % GWOCN 2.379 05/14/30	0	50	0	50 CAD	89.38%	29'012.67	0.00	a)
CA39191ZBB46	3.2600 % GTAAIR 3.26 06/01/37	150	0	0	150 CAD	86.48%	84'210.08	0.01	a)
CA40427HTM56	1.7820 % RY 1.782 05/20/26 DPNT	0	50	0	50 CAD	94.11%	30'548.04	0.00	a)
CA438121AS48	3.4440 % HND A 3.444 05/23/25	50	0	0	50 CAD	98.19%	31'874.05	0.00	a)
CA44810ZAP59	5.3600 % HYDNE 5.36 05/20/36 MTN	50	0	0	50 CAD	105.75%	34'325.45	0.00	a)
CA44810ZBR07	2.7700 % HYDNE 2.77 02/24/26 MTN	50	0	0	50 CAD	96.75%	31'404.67	0.00	a)
CA44810ZBS89	3.9100 % HYDNE 3.91 02/23/46 MTN	50	0	0	50 CAD	89.31%	28'988.98	0.00	a)
CA44810ZBX74	3.6300 % HYDNE 3.63 06/25/49 MTN	40	0	0	40 CAD	84.69%	21'992.49	0.00	a)
CA44810ZCG33	2.2300 % HYDNE 2.23 09/17/31	0	70	0	70 CAD	86.58%	39'345.30	0.00	a)
CA44810ZCM01	4.4600 % HYDNE 4.46 01/27/53 MTN	0	50	0	50 CAD	96.84%	31'434.86	0.00	a)
CA4488148V86	4.0000 % QHEL 4 02/15/55	170	0	0	170 CAD	95.48%	105'370.94	0.01	a)
CA448814HZ92	5.0000 % QHEL 5 02/15/45 JM	100	0	0	100 CAD	108.17%	70'223.27	0.01	a)
CA448814JA24	5.0000 % QHEL 5 02/15/50 JN	100	0	0	100 CAD	110.93%	72'015.73	0.01	a)
CA448814JC89	2.1000 % QHEL 2.1 02/15/60 JR	150	0	0	150 CAD	61.38%	59'771.38	0.01	a)
CA448814JD62	4.0000 % QHEL 4 02/15/63	0	60	0	60 CAD	96.06%	37'418.00	0.00	a)
CA44889ZCM64	6.5000 % QHEL 6 1/2 02/15/35 19	100	0	0	100 CAD	119.70%	77'711.86	0.01	a)
CA44889ZCN48	6.0000 % QHEL 6 02/15/40 MTN	100	0	0	100 CAD	118.66%	77'034.74	0.01	a)
CA44889ZFE12	2.0000 % QHEL 2 09/01/28	0	50	0	50 CAD	91.94%	29'844.95	0.00	a)
CA44889ZFO09	3.4000 % QHEL 3.4 09/01/29	0	70	0	70 CAD	97.17%	44'159.68	0.00	a)
CA449586AC09	3.4400 % IGMCN 3.44 01/26/27	100	0	0	100 CAD	96.12%	62'404.24	0.01	a)
CA45075EAA25	3.0720 % IAGCN 3.072 09/24/31	50	0	0	50 CAD	95.17%	30'890.82	0.00	a)
CA458182EK46	3.4000 % IADB 3.4 05/24/28 GDIF	0	40	0	40 CAD	97.90%	25'423.15	0.00	a)
CA45823TAN69	5.2760 % IFCCN 5.276 09/14/54	0	40	0	40 CAD	107.81%	27'996.86	0.00	a)
CA45823ZAF95	2.8500 % IFCCN 2.85 06/07/27 MTN	50	0	0	50 CAD	95.20%	30'903.48	0.00	a)
CA45833VAG47	6.3800 % IPLCN 6.38 02/17/33	0	70	0	70 CAD	104.75%	47'603.91	0.00	a)
CA45834ZAP41	3.4840 % IPLCN 3.484 12/16/26 MTN	50	0	0	50 CAD	96.13%	31'205.37	0.00	a)
CA459058HS51	1.9000 % IBRD 1.9 01/16/25 GDIF	100	0	0	100 CAD	97.56%	63'338.44	0.01	a)
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	0	100	0	100 CAD	99.09%	64'331.73	0.01	a)
CA45950KDC14	3.3000 % IFC 3.3 05/10/28	0	50	0	50 CAD	97.52%	31'654.94	0.00	a)
CA47788ZAN11	4.9500 % DE 4.95 06/14/27	0	70	0	70 CAD	101.44%	46'097.43	0.00	a)
CA539481AM35	4.4880 % LCN 4.488 12/11/28	50	0	0	50 CAD	99.73%	32'372.96	0.00	a)
CA539481AN18	2.2840 % LCN 2.284 05/07/30	0	50	0	50 CAD	87.86%	28'519.28	0.00	a)
CA539481AQ49	5.3360 % LCN 5.336 09/13/52	0	50	0	50 CAD	104.41%	33'892.10	0.00	a)
CA56344ZQC63	3.2500 % MP 3 1/4 09/05/29 MTN	60	0	0	60 CAD	96.37%	37'537.59	0.00	a)
CA563469TH86	4.7000 % MP 4.7 03/05/50 MTN	30	0	0	30 CAD	103.77%	20'210.81	0.00	a)
CA563469TM71	4.1000 % MP 4.1 03/05/41	100	0	0	100 CAD	95.09%	61'734.91	0.01	a)
CA563469UB97	4.0500 % MP 4.05 09/05/45	100	0	0	100 CAD	93.63%	60'781.87	0.01	a)
CA563469UE37	2.4500 % MP 2.45 06/02/25	100	0	0	100 CAD	97.42%	63'247.56	0.01	a)
CA563469UF02	2.8500 % MP 2.85 09/05/46	30	0	0	30 CAD	76.67%	14'932.57	0.00	a)
CA563469UJ24	2.5500 % MP 2.55 06/02/26	0	40	0	40 CAD	96.40%	25'032.07	0.00	a)
CA563469UN36	3.4000 % MP 3.4 09/05/48	40	0	0	40 CAD	83.86%	21'777.21	0.00	a)
CA563469UP83	2.6000 % MP 2.6 06/02/27	50	0	0	50 CAD	95.65%	31'047.93	0.00	a)
CA563469US23	3.2000 % MP 3.2 03/05/50	100	0	0	100 CAD	80.80%	52'455.81	0.00	a)
CA563469UX18	2.0500 % MP 2.05 06/02/31	0	50	0	50 CAD	87.43%	28'380.35	0.00	a)
CA563469VB88	3.8000 % MP 3.8 06/02/33	0	60	0	60 CAD	96.87%	37'733.13	0.00	a)
CA565018DB16	2.3780 % MFCCN 2.378 11/19/24 DPNT	50	0	0	50 CAD	98.16%	31'861.71	0.00	a)
CA565018RAF34	3.0490 % MFCCN 3.049 08/20/29	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA56501RAQ98	5.4090 % MFCCN 5.409 03/10/33	0	50	0	50 CAD	101.69%	33'007.88	0.00	a)
CA580135CD12	3.1250 % MCD 3 1/8 03/04/25 MPLE	70	0	0	70 CAD	98.17%	44'611.85	0.00	a)
CA59162NAF65	3.3900 % MRUCN 3.39 12/06/27 MTN	100	0	0	100 CAD	96.29%	62'511.36	0.01	a)
CA592179KA25	1.9500 % MET 1.95 03/20/28 MPLE	0	40	0	40 CAD	90.65%	23'539.94	0.00	a)
CA614852J931	3.0000 % MNTRL 3 09/01/27	100	0	0	100 CAD	96.42%	62'594.46	0.01	a)
CA614852NZ03	3.5000 % MNTRL 3 1/2 12/01/38	100	0	0	100 CAD	88.56%	57'491.05	0.01	a)
CA626209JC59	4.9500 % BCMFA 4.95 12/01/27	100	0	0	100 CAD	103.22%	67'007.75	0.01	a)
CA626209JR29	2.5000 % BCMFA 2 1/2 04/19/26	70	0	0	70 CAD	96.33%	43'776.13	0.00	a)
CA628957AH53	2.9240 % NAVCAN 2.924 09/29/51	150	0	0	150 CAD	75.22%	73'245.00	0.01	a)
CA63306AGE07	2.5800 % NACN 2.58 02/03/25	60	0	0	60 CAD	97.76%	38'077.86	0.00	a)
CA63306AHB58	2.2370 % NACN 2.237 11/04/26	100	0	0	100 CAD	93.91%	60'966.90	0.01	a)
CA642866FW27	4.6500 % NBRNS 4.65 09/26/35	50	0	0	50 CAD	103.15%	33'483.43	0.00	a)
CA642866GA97	4.8000 % NBRNS 4.8 09/26/39	40	0	0	40 CAD	104.15%	27'046.94	0.00	a)
CA642866GG67	3.8000 % NBRNS 3.8 08/14/45	50	0	0	50 CAD	90.63%	29'417.78	0.00	a)
CA642866GL52	3.1000 % NBRNS 3.1 08/14/48	50	0	0	50 CAD	79.93%	25'943.88	0.00	a)
CA642866GM36	2.3500 % NBRNS 2.35 08/14/27	50	0	0	50 CAD	94.57%	30'696.39	0.00	a)
CA642866GN19	3.1000 % NBRNS 3.1 08/14/28	0	40	0	40 CAD	96.44%	25'044.79	0.00	a)
CA642866GR23	1.8000 % NBRNS 1.8 08/14/25	0	30	0	30 CAD	96.21%	18'738.80	0.00	a)
CA642869AA90	4.8000 % NBRNS 4.8 06/03/41	50	0	0	50 CAD	103.98%	33'753.50	0.00	a)
CA651333FR20	4.6500 % NF 4.65 10/17/40	40	0	0	40 CAD	99.97%	25'960.95	0.00	a)
CA651333FS03	2.3000 % NF 2.3 06/02/25	50	0	0	50 CAD	97.18%	31'546.20	0.00	a)
CA651333FT85	3.3000 % NF 3.3 10/17/46	0	40	0	40 CAD	80.28%	20'847.55	0.00	a)
CA651333GC42	2.8500 % NF 2.85 06/02/29	100	0	0	100 CAD	94.31%	61'225.28	0.01	a)
CA651333GD25	2.6500 % NF 2.65 10/17/50	100	0	0	100 CAD	69.72%	45'264.56	0.00	a)
CA651333GG55	2.0500 % NF 2.05 06/02/31	0	40	0	40 CAD	86.66%	22'503.02	0.00	a)
CA663307AA47	3.2000 % NWRWPT 3.2 07/22/24 A	150	0	150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA663307AJ55	4.1500 % NWRWPT 4.15 06/01/33 H	50	0	0	50 CAD	95.41%	30'971.33	0.00	a)
CA663307AK29	4.3500 % NWRWPT 4.35 01/10/39 I	0	50	0	50 CAD	94.14%	30'559.41	0.00	a)
CA663307AP16	2.0000 % NWRWPT 2 12/01/26 M	0	50	0	50 CAD	93.38%	30'310.76	0.00	a)
CA6698278Z37	4.4000 % NS 4.4 06/01/42	50	0	0	50 CAD	99.06%	32'153.53	0.00	a)
CA669827FQ59	4.5000 % NS 4 1/2 06/01/37	40	0	0	40 CAD	101.35%	26'319.31	0.00	a)
CA669827GA98	2.1000 % NS 2.1 06/01/27	100	0	0	100 CAD	94.16%	61'126.60	0.01	a)
CA669827GB71	3.1500 % NS 3.15 12/01/51	140	0	0	140 CAD	80.32%	72'997.33	0.01	a)
CA669827BC29	4.5000 % NSIUCN 4 1/2 07/20/43 MTN	50	0	0	50 CAD	90.55%	29'393.43	0.00	a)
CA67103MAF38	2.9800 % OPBFIN 2.98 01/25/27 F	40	0	0	40 CAD	96.31%	25'010.78	0.00	a)
CA68214WAQ11	3.2440 % OMERS 3.244 10/04/27 9	50	0	0	50 CAD	95.71%	31'066.44	0.00	a)
CA683078GB94	8.5000 % OHYD 8 1/2 05/26/25	100	0	0	100 CAD	104.49%	67'832.90	0.01	a)
CA68321ZAD39	2.9770 % ONTPOW 2.977 09/13/29 MTN	70	0	0	70 CAD	92.89%	42'214.66	0.00	a)
CA68321ZAJ09	2.9470 % ONTPOW 2.947 02/21/51	100	0	0	100 CAD	71.14%	46'187.08	0.00	a)
CA683234B984	4.6500 % ONT 4.65 06/02/41	195	40	0	235 CAD	103.36%	157'689.44	0.01	a)
CA683234KG29	7.6000 % ONT 7.6 06/02/27 KJ	80	0	0	80 CAD	110.76%	57'522.21	0.01	a)
CA683234LJ58	6.5000 % ONT 6 1/2 03/08/29	70	60	0	130 CAD	111.42%	94'035.68	0.01	a)
CA683234NL86	5.7000 % ONT 5.7 12/02/39 MTN	0	30	0	30 CAD	114.39%	22'278.79	0.00	a)
CA683234NM69	6.2000 % ONT 6.2 06/02/31	50	0	0	50 CAD	113.53%	36'851.83	0.00	a)
CA683234SL32	5.8500 % ONT 5.85 03/08/33	120	0	0	120 CAD	112.42%	87'580.43	0.01	a)
CA683234VR64	5.6000 % ONT 5.6 06/02/35	130	0	0	130 CAD	112.19%	94'680.47	0.01	a)
CA683234YD42	4.7000 % ONT 4.7 06/02/37	100	30	0	130 CAD	104.18%	87'921.13	0.01	a)
CA683234ZP62	4.6000 % ONT 4.6 06/02/39	240	0	0	240 CAD	102.94%	160'382.35	0.01	a)
CA68323AAY07	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/43	200	50	0	250 CAD	88.75%	144'047.36	0.01	a)
CA68323ACC68	3.4500 % ONT 3.45 06/02/45	280	40	0	320 CAD	87.38%	181'528.27	0.02	a)
CA68323ACG72	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/24	200	0	200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68323ACX06	2.6000 % ONT 2.6 06/02/25	200	30	0	230 CAD	97.62%	145'760.55	0.01	a)
CA68323ACY88	2.9000 % ONT 2.9 12/02/46	240	60	0	300 CAD	79.11%	154'066.22	0.01	a)
CA68323ADM32	2.4000 % ONT 2.4 06/02/26	200	0	0	200 CAD	96.11%	124'786.40	0.01	a)
CA68323ADZ45	2.8000 % ONT 2.8 06/02/48	200	40	0	240 CAD	77.09%	120'113.42	0.01	a)
CA68323AEE07	2.6000 % ONT 2.6 06/02/27	70	80	0	150 CAD	95.71%	93'206.12	0.01	a)
CA68323AER10	2.6500 % ONT 2.65 02/05/25	70	0	0	70 CAD	98.17%	44'614.58	0.00	a)
CA68333ZAA53	2.9000 % ONT 2.9 06/02/49	180	60	0	240 CAD	78.16%	121'780.58	0.01	a)
CA68333ZAC10	2.9000 % ONT 2.9 06/02/28	190	0	0	190 CAD	96.01%	118'428.67	0.01	a)
CA68333ZAE75	2.7000 % ONT 2.7 06/02/29	140	40	0	180 CAD	94.17%	110'038.40	0.01	a)
CA68333ZAF41	2.3000 % ONT 2.3 09/08/24	0	60	60	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA68333ZAG24	2.6500 % ONT 2.65 12/02/50	250	0	0	250 CAD	74.10%	120'268.58	0.01	a)
CA68333ZAH07	2.0500 % ONT 2.05 06/02/30	230	0	0	230 CAD	89.41%	133'510.56	0.01	a)
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	70	50	0	120 CAD	94.01%	73'235.84	0.01	a)
CA68333ZAK36	1.7500 % ONT 1 3/4 09/08/25	200	0	0	200 CAD	96.05%	124'705.90	0.01	a)
CA68333ZAL19	1.9000 % ONT 1.9 12/02/51	270	0	0	270 CAD	62.01%	108'694.54	0.01	a)
CA68333ZAM91	1.0500 % ONT 1.05 09/08/27	100	0	0	100 CAD	90.54%	58'778.42	0.01	a)
CA68333ZAN74	1.3500 % ONT 1.35 12/02/30	80	60	0	140 CAD	84.41%	76'721.04	0.01	a)
CA68333ZAP23	2.1500 % ONT 2.15 06/02/31	140	0	0	140 CAD	88.29%	80'242.07	0.01	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	90	0	0	90 CAD	87.92%	51'372.09	0.00	a)
CA68333ZAS61	2.5500 % ONT 2.55 12/02/52	100	60	0	160 CAD	72.08%	74'866.39	0.01	a)
CA68333ZAT45	2.2500 % ONT 2 1/4 12/02/31	170	0	0	170 CAD	88.05%	97'171.92	0.01	a)
CA68333ZAU18	3.7500 % ONT 3 3/4 06/02/32	60	100	0	160 CAD	97.57%	101'343.59	0.01	a)
CA68333ZAV90	3.7500 % ONT 3 3/4 12/02/53	150	120	0	270 CAD	91.85%	160'999.74	0.01	a)
CA68333ZAW73	3.6000 % ONT 3.6 03/08/28	0	80	0	80 CAD	98.70%	51'261.79	0.00	a)
CA68333ZAX56	4.0500 % ONT 4.05 02/02/32	0	60	0	60 CAD	99.92%	38'921.17	0.00	a)
CA68333ZAY30	3.6500 % ONT 3.65 06/02/33	0	250	0	250 CAD	96.21%	156'150.17	0.01	a)
CA68333ZAZ05	3.4000 % ONT 3.4 09/08/28	0	50	0	50 CAD	97.79%	31'742.91	0.00	a)
CA68333ZBA45	4.1500 % ONT 4.15 12/02/54	0	140	0	140 CAD	98.73%	89'735.40	0.01	a)
CA689551FG93	2.5000 % OTTAWA 2 1/2 05/11/51	0	60	0	60 CAD	68.63%	26'732.99	0.00	a)
CA689551FJ33	4.4500 % OTTAWA 4.45 06/04/33	0	60	0	60 CAD	101.61%	39'581.03	0.00	a)
CA69363TAN24	2.0500 % P5PCAP 2.05 01/15/30 12	0	150	0	150 CAD	89.85%	87'496.68	0.01	a)
CA69363TAQ54	1.5000 % P5PCAP 1 1/2 03/15/28 14	150	0	0	150 CAD	90.83%	88'449.07	0.01	a)
CA705464HE85	2.5000 % PEEL 2 1/2 06/16/51	100	0	0	100 CAD	68.38%	44'393.33	0.00	a)
CA70632ZAD39	4.8100 % PPLCN 4.81 03/25/44 MTN	40	0	0	40 CAD	90.22%	23'428.53	0.00	a)
CA70632ZAF86	4.2400 % PPLCN 4.24 06/15/27 MTN	40	0	0	40 CAD	98.43%	25'559.22	0.00	a)
CA70632ZAM38	3.6200 % PPLCN 3.62 04/03/29 MTN	50	0	0	50 CAD	94.76%	30'760.66	0.00	a)
CA70632ZAN11	4.5400 % PPLCN 4.54 04/03/49 MTN	50	0	0	50 CAD	85.69%	27'816.19	0.00	a)
CA741666DE80	3.7500 % PRINCE 3 3/4 12/01/32	40	0	0	40 CAD	96.36%	25'023.50	0.00	a)
CA74340XCD18	5.2500 % PLD 5 1/4 01/15/31	0	40	0	40 CAD	102.96%	26'737.14	0.00	a)
CA748148PZ01	8.5000 % Q 8 1/2 04/01/26	0	40	0	40 CAD	108.26%	28'113.72	0.00	a)
CA748148QJ59	6.0000 % Q 6 10/01/29 OS	50	0	0	50 CAD	110.04%	35'719.62	0.00	a)
CA748148QT32	6.2500 % Q 6 1/4 06/01/32	90	0	0	90 CAD	114.59%	66'953.22	0.01	a)
CA748148RL96	5.7500 % Q 5 3/4 12/01/36	100	0	0	100 CAD	114.35%	74'236.01	0.01	a)
CA74814ZDK62	5.0000 % Q 5 12/01/38	150	0	0	150 CAD	107.31%	104'502.30	0.01	a)
CA74814ZEF68	5.0000 % Q 5 12/01/41	140	0	0	140 CAD	107.48%	97'688.17	0.01	a)
CA74814ZEK53	4.2500 % Q 4 1/4 12/01/43	120	0	0	120 CAD	98.31%	76'588.86	0.01	a)
CA74814ZER07	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/45	180	0	0	180 CAD	87.84%	102'647.19	0.01	a)
CA74814ZES89	3.7500 % Q 3 3/4 09/01/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZEV19	2.7500 % Q 2 3/4 09/01/25	130	0	0	130 CAD	97.53%	82'312.97	0.01	a)
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	280	0	0	280 CAD	87.21%	158'535.49	0.01	a)
CA74814ZEX74	2.5000 % Q 2 1/2 09/01/26	90	60	0	150 CAD	96.14%	93'624.86	0.01	a)
CA74814ZFB46	2.7500 % Q 2 3/4 09/01/27	100	0	0	100 CAD	96.08%	62'373.73	0.01	a)
CA74814ZFD02	2.7500 % Q 2 3/4 09/01/28	90	0	0	90 CAD	95.16%	55'599.39	0.01	a)
CA74814ZFE84	3.1000 % Q 3.1 12/01/51	420	0	0	420 CAD	80.99%	220'818.84	0.02	a)
CA74814ZFF59	2.3000 % Q 2.3 09/01/29	100	70	0	170 CAD	91.97%	101'503.75	0.01	a)
CA74814ZFG33	1.9000 % Q 1.9 09/01/30	200	0	0	200 CAD	88.17%	114'477.02	0.01	a)
CA74814ZFH16	1.5000 % Q 1 1/2 09/01/31	200	0	0	200 CAD	83.74%	108'730.25	0.01	a)
CA74814ZFL28	2.8500 % Q 2.85 12/01/53	0	60	0	60 CAD	76.64%	29'851.51	0.00	a)
CA74814ZFN83	3.2500 % Q 3 1/4 09/01/32	0	220	0	220 CAD	93.90%	134'115.75	0.01	a)
CA74814ZFQ15	4.4000 % Q 4.4 12/01/55	0	190	0	190 CAD	102.92%	126'954.56	0.01	a)
CA74814ZFS70	3.6000 % Q 3.6 09/01/33	0	200	0	200 CAD	95.70%	124'259.25	0.01	a)
CA766910BK85	5.6110 % REIUCN 5.611 10/06/27	0	50	0	50 CAD	101.39%	32'910.50	0.00	a)
CA766910BL68	5.9620 % REIUCN 5.962 10/01/29	0	50	0	50 CAD	103.14%	33'479.86	0.00	a)
CA775109AQ41	6.1100 % RCICN 6.11 08/25/40	100	0	0	100 CAD	106.52%	69'154.68	0.01	a)
CA775109BK61	3.6500 % RCICN 3.65 03/31/27	100	0	0	100 CAD	96.79%	62'838.56	0.01	a)
CA775109CQ23	3.3000 % RCICN 3.3 12/10/29	0	60	0	60 CAD	92.31%	35'956.90	0.00	a)
CA775109CT61	6.7500 % RCICN 6 3/4 11/09/39	0	50	0	50 CAD	113.20%	36'746.01	0.00	a)
CA780085N938	4.9300 % RY 4.93 07/16/25 DPNT	100	0	0	100 CAD	100.10%	64'984.83	0.01	a)
CA780086QY32	2.3520 % RY 2.352 07/02/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA780086RQ98	2.3280 % RY 2.328 01/28/27	100	0	0	100 CAD	93.76%	60'869.52	0.01	a)
CA780086SA38	2.0880 % RY 2.088 06/30/30	60	0	0	60 CAD	96.04%	37'408.65	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA780086UL64	2.9400 % RY 2.94 05/03/32	100	0	0	100 CAD	93.99%	61'018.18	0.01	a)
CA780086UT90	3.3690 % RY 3.369 09/29/25	100	0	0	100 CAD	97.57%	63'345.59	0.01	a)
CA780086XL38	4.6320 % RY 4.632 05/01/28	0	100	0	100 CAD	99.98%	64'910.17	0.01	a)
CA80310ZAF68	2.8760 % SAPCN 2.876 11/19/24 MTN	70	0	0	70 CAD	98.40%	44'719.10	0.00	a)
CA803854JA70	5.8000 % SCDA 5.8 09/05/33	50	0	0	50 CAD	112.47%	36'506.45	0.00	a)
CA803854JL36	4.7500 % SCDA 4 3/4 06/01/40	40	0	0	40 CAD	104.09%	27'031.10	0.00	a)
CA803854JU35	3.9000 % SCDA 3.9 06/02/45	50	0	0	50 CAD	92.98%	30'182.54	0.00	a)
CA803854KB35	2.5500 % SCDA 2.55 06/02/26	40	40	0	80 CAD	96.40%	50'064.66	0.00	a)
CA803854KC18	3.3000 % SCDA 3.3 06/02/48	40	0	0	40 CAD	83.82%	21'765.27	0.00	a)
CA803854KF49	3.0500 % SCDA 3.05 12/02/28	60	0	0	60 CAD	96.13%	37'446.44	0.00	a)
CA803854KG22	2.9500 % SCDA 2.95 06/02/58 MTN	60	0	0	60 CAD	75.97%	29'593.65	0.00	a)
CA803854KH05	3.1000 % SCDA 3.1 06/02/50	60	0	0	60 CAD	80.60%	31'396.36	0.00	a)
CA803854KJ60	2.2000 % SCDA 2.2 06/02/30	50	0	0	50 CAD	90.14%	29'258.40	0.00	a)
CA803854KN72	2.8000 % SCDA 2.8 12/02/52	0	50	0	50 CAD	75.49%	24'504.59	0.00	a)
CA82028KAQ46	6.7500 % RCICN 6 3/4 11/09/39	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA82028KAZ45	3.3000 % RCICN 3.3 12/10/29	60	0	60	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA83179XAK42	3.5260 % SRUUCN 3.526 12/20/29 U	50	0	0	50 CAD	90.89%	29'502.82	0.00	a)
CA83740TAJ66	1.6000 % SOUCOA 1.6 07/03/30	0	50	0	50 CAD	86.49%	28'073.92	0.00	a)
CA83740TAK30	4.1500 % SOUCOA 4.15 12/12/53	40	0	0	40 CAD	94.01%	24'412.21	0.00	a)
CA86682ZAL00	2.3800 % SLFCN 2.38 08/13/29	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA86682ZAQ96	2.8000 % SLFCN 2.8 11/21/33	100	0	0	100 CAD	91.55%	59'433.47	0.01	a)
CA86682ZAT36	5.5000 % SLFCN 5 1/2 07/04/35	0	50	0	50 CAD	103.08%	33'460.71	0.00	a)
CA87971MAW34	4.8500 % TCN 4.85 04/05/44 CP	40	0	0	40 CAD	92.72%	24'078.26	0.00	a)
CA87971MAX17	3.7500 % TCN 3 3/4 01/17/25 CQ	40	0	0	40 CAD	98.85%	25'670.37	0.00	a)
CA87971MBJ14	3.3000 % TCN 3.3 05/02/29 CY	50	0	0	50 CAD	93.65%	30'397.75	0.00	a)
CA87971MBN26	3.1500 % TCN 3.15 02/19/30 CAA	60	0	0	60 CAD	91.58%	35'672.94	0.00	a)
CA87971MBP73	3.9500 % TCN 3.95 02/16/50 CAB	60	0	0	60 CAD	79.55%	30'986.58	0.00	a)
CA87971MBX08	5.2500 % TCN 5 1/4 11/15/32 CAG	50	0	0	50 CAD	101.78%	33'036.45	0.00	a)
CA884903BW40	2.2390 % TRICN 2.239 05/14/25	100	0	0	100 CAD	96.79%	62'834.66	0.01	a)
CA8911457R92	4.8590 % TD 4.859 03/04/31 MTN	40	0	0	40 CAD	99.66%	25'879.41	0.00	a)
CA891160QY28	3.2240 % TD 3.224 07/25/29 MTN	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117F7H69	5.3760 % TD 5.376 10/21/27	100	0	0	100 CAD	102.34%	66'439.05	0.01	a)
CA89117F8V45	4.3440 % TD 4.344 01/27/26	100	0	0	100 CAD	99.09%	64'327.19	0.01	a)
CA89117FNR69	2.4960 % TD 2.496 12/02/24	100	0	0	100 CAD	98.12%	63'700.05	0.01	a)
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	100	0	0	100 CAD	94.67%	61'458.99	0.01	a)
CA89117GRJ80	4.6800 % TD 4.68 01/08/29	0	50	0	50 CAD	100.08%	32'484.95	0.00	a)
CA89117GX510	5.4910 % TD 5.491 09/08/28	0	50	0	50 CAD	103.37%	33'553.87	0.00	a)
CA89119ZAL72	2.4300 % TORHYD 2.43 12/11/29 14	50	0	0	50 CAD	90.77%	29'462.90	0.00	a)
CA891288DQ20	2.4000 % TRNT 2.4 06/07/27	100	0	0	100 CAD	94.90%	61'608.31	0.01	a)
CA891288DR03	3.2000 % TRNT 3.2 08/01/48	50	0	0	50 CAD	79.64%	25'852.67	0.00	a)
CA891288DT68	2.6000 % TRNT 2.6 09/24/39	100	0	0	100 CAD	78.73%	51'109.36	0.00	a)
CA892329BN24	1.6600 % TOYOTA 1.66 07/20/26 MTN	200	0	0	200 CAD	93.59%	121'511.81	0.01	a)
CA89353ZBV90	4.5500 % TRPCN 4.55 11/15/41 MTN	80	0	0	80 CAD	89.35%	46'406.25	0.00	a)
CA89353ZCB28	4.3300 % TRPCN 4.33 09/16/47 MTN	40	0	0	40 CAD	84.63%	21'977.17	0.00	a)
CA89353ZCC01	4.1800 % TRPCN 4.18 07/03/48 MTN	50	0	0	50 CAD	82.32%	26'720.98	0.00	a)
CA89353ZCF32	3.8000 % TRPCN 3.8 04/05/27	100	0	0	100 CAD	97.43%	63'250.15	0.01	a)
CA89353ZCN65	5.2770 % TRPCN 5.277 07/15/30 MTN	0	70	0	70 CAD	102.29%	46'484.16	0.00	a)
CA90664ZAX83	2.8800 % ENBGAS 2.88 11/22/27 MTN	50	0	0	50 CAD	94.76%	30'758.06	0.00	a)
CA90664ZAY66	3.5900 % ENBGAS 3.59 11/22/47 MTN	50	0	0	50 CAD	83.37%	27'060.51	0.00	a)
CA918423AW48	2.8500 % VW 2.85 09/26/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA918423BD57	5.7500 % VW 5 3/4 09/21/26	0	50	0	50 CAD	101.93%	33'088.06	0.00	a)
CA92277LAF37	2.8000 % VTR 2.8 04/12/24 E	70	0	70	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA92343VFG47	2.5000 % VZ 2 1/2 05/16/30 MPLE	50	0	0	50 CAD	88.28%	28'655.93	0.00	a)
CA949746RX19	2.9750 % WFC 2.975 05/19/26 MPLE	100	0	0	100 CAD	96.02%	62'336.72	0.01	a)
CA98704CQY52	2.5000 % YORKMU 2 1/2 06/02/26	100	0	0	100 CAD	96.18%	62'442.54	0.01	a)
CAC04575AG89	3.1270 % ATH 3.127 03/10/25 MTN	0	60	0	60 CAD	97.58%	38'008.13	0.00	a)
CAU60901AG70	3.4400 % TAP 3.44 07/15/26 MPLE	50	0	0	50 CAD	96.82%	31'429.34	0.00	a)
US458182CZ31	4.4000 % IADB 4.4 01/26/26	0	40	0	40 CAD	100.01%	25'970.82	0.00	a)
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	60	0	0	60 CAD	93.23%	36'316.82	0.00	a)
XS2102297012	1.9000 % EIB 1.9 01/22/25 REGS	80	0	0	80 CAD	97.53%	50'652.58	0.00	a)
CAD							29'563'784.97	2.71	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND100002GY0	4.4200 % SDBC 4.42 04/07/40 1007	1'000	0	0	1'000 CNY	123.82%	151'316.14	0.01	a)
CND100007B02	4.4200 % CGB 4.42 03/20/24 1405	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100007L51	4.0000 % CGB 4.06/19/24 1412	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100008127	3.7700 % CGB 3.77 12/18/24 1429	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100008408	4.2900 % EXIMCH 4.29 04/07/25 1508	2'000	0	0	2'000 CNY	102.43%	250'358.38	0.02	a)
CND100008457	3.9700 % ADBCH 3.97 02/27/25 1505	1'000	0	0	1'000 CNY	102.07%	124'734.35	0.01	a)
CND1000084C1	3.6400 % CGB 3.64 04/09/25 1505	3'000	0	0	3'000 CNY	102.15%	374'492.68	0.03	a)
CND100008531	3.8100 % SDBC 3.81 02/05/25 1505	1'000	0	0	1'000 CNY	101.77%	124'377.50	0.01	a)
CND1000086W4	4.2100 % SDBC 4.21 04/13/25 1510	2'000	1'000	0	3'000 CNY	102.40%	375'412.92	0.03	a)
CND100008MV1	3.5100 % CGB 3.51 07/16/25 1516	3'000	0	0	3'000 CNY	102.54%	375'955.53	0.03	a)
CND100008S02	3.8700 % EXIMCH 3.87 09/14/25 1514	4'000	0	2'000	2'000 CNY	102.55%	250'654.13	0.02	a)
CND100008S93	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	5'000	1'000	2'000	4'000 CNY	102.41%	500'604.33	0.05	a)
CND100008T84	3.7400 % CGB 3.74 09/22/35 1521	3'800	0	0	3'800 CNY	113.68%	527'939.42	0.05	a)
CND100008YF9	3.7400 % CGB 3.74 10/20/45 1525	1'000	0	0	1'000 CNY	121.15%	148'050.70	0.01	a)
CND100009CF3	3.3300 % ADBCH 3.33 01/06/26 1605	2'000	1'000	0	3'000 CNY	102.06%	374'177.38	0.03	a)
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	3'000	1'000	0	4'000 CNY	112.56%	550'255.61	0.05	a)
CND100009CX6	2.8500 % CGB 2.85 01/28/26 1604	3'000	0	0	3'000 CNY	101.57%	372'369.90	0.03	a)
CND100009JW3	3.3700 % ADBCH 3.37 02/26/26 1608	2'000	0	0	2'000 CNY	102.30%	250'050.41	0.02	a)
CND100009JY9	3.9500 % ADBCH 3.95 02/26/36 1610	1'000	0	0	1'000 CNY	113.74%	139'004.75	0.01	a)
CND100009K58	3.3300 % EXIMCH 3.33 02/22/26 1603	3'000	0	0	3'000 CNY	102.17%	374'591.67	0.03	a)
CND100009R93	3.1800 % SDBC 3.18 04/05/26 1610	4'000	1'000	0	5'000 CNY	102.02%	623'378.44	0.06	a)
CND100009RF1	3.5200 % CGB 3.52 04/25/46 1608	500	0	0	500 CNY	115.51%	70'580.26	0.01	a)
CND100009SC6	3.5800 % ADBCH 3.58 04/22/26 1618	2'700	0	0	2'700 CNY	102.89%	339'514.86	0.03	a)
CND10000BLB2	3.2700 % CGB 3.27 08/22/46 1619	2'000	0	0	2'000 CNY	111.73%	273'084.46	0.02	a)
CND10000BTG4	3.1800 % EXIMCH 3.18 09/05/26 1610	2'000	1'000	0	3'000 CNY	102.27%	374'961.97	0.03	a)
CND10000BV90	3.0500 % SDBC 3.05 08/25/26 1613	3'600	1'000	0	4'600 CNY	101.99%	573'328.27	0.05	a)
CND10000C5Z0	2.7000 % CGB 2.7 11/03/26 1623	3'000	0	0	3'000 CNY	101.45%	371'926.28	0.03	a)
CND10000G6R1	4.0100 % SDBC 4.01 01/09/37 1702	1'000	0	0	1'000 CNY	115.61%	141'280.29	0.01	a)
CND10000G727	3.8500 % ADBCH 3.85 01/06/27 1705	3'000	1'000	0	4'000 CNY	104.47%	510'708.61	0.05	a)
CND10000G9Y1	3.4000 % CGB 3.4 02/09/27 1704	4'000	0	0	4'000 CNY	104.00%	508'411.07	0.05	a)
CND10000G9Z8	3.7700 % CGB 3.77 02/20/47 1705	1'000	0	0	1'000 CNY	120.65%	147'442.10	0.01	a)
CND10000H1F6	4.1100 % EXIMCH 4.11 03/20/27 1703	1'000	1'000	0	2'000 CNY	105.46%	257'752.06	0.02	a)
CND10000H1G4	3.2000 % CGB 3.2 03/16/24 1706	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000H4F0	4.0400 % SDBC 4.04 04/10/27 1710	3'300	2'000	0	5'300 CNY	105.27%	681'864.12	0.06	a)
CND10000HS81	4.0500 % CGB 4.05 07/24/47 1715	1'000	0	0	1'000 CNY	125.84%	153'792.10	0.01	a)
CND10000HZF0	4.3000 % SDBC 4.3 08/21/24 1708	1'700	0	1'700	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000J275	4.2400 % SDBC 4.24 08/24/27 1715	3'000	1'000	0	4'000 CNY	106.41%	520'162.74	0.05	a)
CND10000J7H7	4.3900 % ADBCH 4.39 09/08/27 1715	3'000	1'000	0	4'000 CNY	107.04%	523'227.75	0.05	a)
CND10000JH82	4.2800 % CGB 4.28 10/23/47 1722	500	0	0	500 CNY	130.05%	79'463.67	0.01	a)
CND10000JJ72	3.8200 % CGB 3.82 11/02/27 1725	3'000	0	0	3'000 CNY	106.54%	390'613.34	0.04	a)
CND10000L5W6	4.9800 % ADBCH 4.98 01/12/25 1801	2'100	0	2'100	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000L7C4	4.8800 % SDBC 4.88 02/09/28 1805	4'000	1'000	0	5'000 CNY	109.70%	670'319.11	0.06	a)
CND10000LMZ8	4.2200 % CGB 4.22 03/19/48 1806	2'000	0	0	2'000 CNY	129.44%	316'380.84	0.03	a)
CND10000LNZ6	4.8900 % EXIMCH 4.89 03/26/28 1810	2'500	0	0	2'500 CNY	109.79%	335'431.47	0.03	a)
CND10000LPY4	4.7300 % SDBC 4.73 04/02/25 1806	2'600	0	0	2'600 CNY	102.94%	327'076.86	0.03	a)
CND100010GW7	4.6500 % ADBCH 4.65 05/11/28 1806	3'300	0	0	3'300 CNY	109.12%	440'063.46	0.04	a)
CND100011220	4.0400 % SDBC 4.04 07/06/28 1810	4'800	1'000	0	5'800 CNY	107.10%	759'112.62	0.07	a)
CND1000113G9	3.9700 % CGB 3.97 07/23/48 1817	3'200	0	0	3'200 CNY	125.05%	489'021.80	0.04	a)
CND10001QNZ3	4.1500 % SDBC 4.15 10/26/25 1814	1'900	0	0	1'900 CNY	103.28%	239'811.82	0.02	a)
CND10001QZV6	4.0000 % ADBCH 4 11/12/25 1811	3'000	0	0	3'000 CNY	103.03%	377'733.68	0.03	a)
CND10001WKZ7	3.4800 % SDBC 3.48 01/08/29 1905	4'800	0	0	4'800 CNY	105.20%	617'103.23	0.06	a)
CND10001X8C7	3.7500 % ADBCH 3 3/4 01/25/29 1901	2'300	1'000	0	3'300 CNY	106.27%	428'581.75	0.04	a)
CND10001YBB3	3.3000 % SDBC 3.3 02/01/24 1903	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	4'000	0	4'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001ZC52	3.6800 % SDBC 3.68 02/26/26 1904	2'000	0	0	2'000 CNY	102.90%	251'516.93	0.02	a)
CND100025Q03	3.5100 % ADBCH 3.51 04/03/24 1904	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100029N10	3.8600 % EXIMCH 3.86 05/20/29 1910	3'000	1'500	0	4'500 CNY	107.05%	588'708.21	0.05	a)
CND100029N93	3.6500 % SDBC 3.65 05/21/29 1910	4'800	1'000	0	5'800 CNY	106.24%	753'038.07	0.07	a)
CND10002CGX0	4.0000 % CGB 4 06/24/69 1908	4'000	0	0	4'000 CNY	134.76%	658'743.42	0.06	a)
CND10002CZL5	3.4200 % SDBC 3.42 07/02/24 1908	3'200	0	3'200	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002D1Y9	3.8600 % CGB 3.86 07/22/49 1910	5'000	0	0	5'000 CNY	123.67%	755'688.55	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND10002D258	3.6300 % ADBCH 3.63 07/19/26 1908	2'000	1'000	0	3'000 CNY	103.18%	378'294.62	0.03	a)
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	4'000	0	0	4'000 CNY	106.63%	521'243.07	0.05	a)
CND10002F4V7	3.5000 % SDBC 3 1/2 08/13/26 1909	1'500	0	0	1'500 CNY	103.12%	189'026.32	0.02	a)
CND10002F519	3.2400 % ADBCH 3.24 08/14/24 1909	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002GGR3	3.4500 % SDBC 3.45 09/20/29 1915	5'000	3'000	2'000	6'000 CNY	105.53%	773'813.44	0.07	a)
CND10002HV84	3.1300 % CGB 3.13 11/21/29 1915	3'500	0	0	3'500 CNY	104.47%	446'852.93	0.04	a)
CND10002KVV4	3.2300 % SDBC 3.23 01/10/25 2003	4'000	0	4'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002KYS6	3.4300 % SDBC 3.43 01/14/27 2004	2'000	1'000	0	3'000 CNY	103.34%	378'855.56	0.03	a)
CND10002LS67	3.2600 % EXIMCH 3.26 02/24/27 2007	2'000	0	0	2'000 CNY	102.88%	251'460.71	0.02	a)
CND10002M036	2.9300 % EXIMCH 2.93 03/02/25 2005	3'000	2'000	0	5'000 CNY	101.01%	617'194.64	0.06	a)
CND10002RWH8	3.0700 % SDBC 3.07 03/10/30 2005	5'000	0	0	5'000 CNY	103.61%	633'106.31	0.06	a)
CND10002TD09	3.2300 % EXIMCH 3.23 03/23/30 2010	4'000	1'000	0	5'000 CNY	104.43%	638'141.35	0.06	a)
CND100031JZ0	1.9900 % CGB 1.99 04/09/25 INBK	3'000	0	0	3'000 CNY	100.05%	366'815.48	0.03	a)
CND100034271	2.9600 % ADBCH 2.96 04/17/30 2004	4'000	1'000	0	5'000 CNY	102.91%	628'841.20	0.06	a)
CND100034370	2.2500 % ADBCH 2 1/4 04/22/25 2005	2'000	1'000	0	3'000 CNY	100.25%	367'530.41	0.03	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	4'500	0	0	4'500 CNY	101.93%	560'567.64	0.05	a)
CND100036VL4	3.7300 % CGB 3.73 05/25/70 INBK	8'000	0	0	8'000 CNY	129.03%	1'261'475.79	0.12	a)
CND100036VN0	2.8700 % ADBCH 2.87 05/14/27	2'000	0	0	2'000 CNY	101.81%	248'852.76	0.02	a)
CND10003BX04	3.0900 % SDBC 3.09 06/18/30 2010	4'000	2'000	0	6'000 CNY	103.82%	761'274.75	0.07	a)
CND10003C5P8	2.8900 % SDBC 2.89 06/22/25 2008	2'000	0	0	2'000 CNY	101.01%	246'877.86	0.02	a)
CND10003F5H9	3.3400 % SDBC 3.34 07/14/25 2012	4'000	0	0	4'000 CNY	101.66%	496'938.05	0.05	a)
CND10003HJY9	3.9000 % SDBC 3.9 08/03/40 2020	3'000	0	0	3'000 CNY	117.00%	428'959.01	0.04	a)
CND10003QXS3	3.4500 % ADBCH 3.45 09/23/25 2008	2'000	1'000	0	3'000 CNY	102.00%	373'946.40	0.03	a)
CND10003RVZ0	3.7000 % SDBC 3.7 10/20/30 2015	5'000	0	0	5'000 CNY	107.36%	656'045.04	0.06	a)
CND10003S2M4	3.4300 % EXIMCH 3.43 10/23/25 2015	1'000	1'000	0	2'000 CNY	102.08%	249'490.69	0.02	a)
CND10003S346	3.7900 % ADBCH 3.79 10/26/30 2010	3'500	1'000	0	4'500 CNY	107.90%	593'371.73	0.05	a)
CND10003VNX4	3.2700 % CGB 3.27 11/19/30 INBK	3'000	0	0	3'000 CNY	106.01%	388'662.87	0.04	a)
CND10003VYQ5	3.7400 % EXIMCH 3.74 11/16/30 2011	3'000	0	0	3'000 CNY	107.64%	394'638.92	0.04	a)
CND100042902	3.4000 % SDBC 3.4 01/08/28 2104	2'000	0	0	2'000 CNY	104.03%	254'259.31	0.02	a)
CND100043ZB2	3.4800 % ADBCH 3.48 02/04/28	2'000	1'000	0	3'000 CNY	104.25%	382'217.54	0.03	a)
CND1000446L3	3.6600 % SDBC 3.66 03/01/31 2105	4'000	2'000	0	6'000 CNY	107.53%	788'456.59	0.07	a)
CND100045707	3.3000 % SDBC 3.3 03/03/26 2103	5'000	0	0	5'000 CNY	102.25%	624'820.51	0.06	a)
CND100045715	3.1900 % ADBCH 3.19 03/03/24 2102	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100045L04	3.3500 % ADBCH 3.35 03/24/26 2103	1'000	2'000	0	3'000 CNY	102.30%	375'071.95	0.03	a)
CND100045MS9	3.7200 % CGB 3.72 04/12/51 INBK	4'000	0	0	4'000 CNY	122.33%	597'975.97	0.05	a)
CND100045PN3	3.1400 % EXIMCH 3.14 04/02/24 2103	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100047PR0	3.2200 % EXIMCH 3.22 05/14/26 2105	3'000	0	0	3'000 CNY	102.20%	374'690.66	0.03	a)
CND100047QT4	3.0200 % CGB 3.02 05/27/31 INBK	2'500	0	0	2'500 CNY	104.45%	319'128.72	0.03	a)
CND100047SF9	3.5200 % ADBCH 3.52 05/24/31 2105	3'000	1'000	0	4'000 CNY	106.70%	521'609.70	0.05	a)
CND1000484F6	3.4100 % SDBC 3.41 06/07/31 2110	4'000	1'000	0	5'000 CNY	106.04%	647'979.21	0.06	a)
CND100049188	3.0000 % SDBC 3 06/17/24 2107	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004BNT2	3.3800 % EXIMCH 3.38 07/16/31 2110	3'000	2'000	0	5'000 CNY	105.92%	647'197.07	0.06	a)
CND10004DT64	2.7800 % ADBCH 2.78 07/21/24 2106	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004JK34	3.0900 % SDBC 3.09 08/09/28 2109	0	1'000	0	1'000 CNY	103.11%	126'012.66	0.01	a)
CND10004JSJ5	2.9900 % ADBCH 2.99 08/11/26 2108	2'000	0	0	2'000 CNY	101.82%	248'874.76	0.02	a)
CND10004KQZ3	3.1900 % ADBCH 3.19 08/12/28	1'000	1'000	0	2'000 CNY	103.46%	252'875.90	0.02	a)
CND10004M1L3	2.8300 % SDBC 2.83 09/10/26 2108	2'000	1'000	0	3'000 CNY	101.55%	372'307.58	0.03	a)
CND10004M1X8	3.1200 % SDBC 3.12 09/13/31 2115	4'000	1'000	0	5'000 CNY	104.23%	636'919.25	0.06	a)
CND10004NCM5	3.5300 % CGB 3.53 10/18/51 INBK	4'000	0	0	4'000 CNY	118.88%	581'115.95	0.05	a)
CND10004NXB4	2.7600 % EXIMCH 2.76 11/05/24 2113	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004NXC2	3.3000 % ADBCH 3.3 11/05/31 2110	3'000	1'000	0	4'000 CNY	105.47%	515'596.99	0.05	a)
CND10004NXL3	3.4900 % SDBC 3.49 11/08/41 2120	0	2'000	0	2'000 CNY	112.68%	275'421.11	0.03	a)
CND10004NXW0	2.8900 % CGB 2.89 11/18/31 INBK	3'000	0	0	3'000 CNY	103.61%	379'852.79	0.03	a)
CND10004P6B0	2.7300 % SDBC 2.73 11/11/24 2118	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004R1S3	3.0000 % SDBC 3 01/17/32 2205	4'000	1'000	0	5'000 CNY	103.53%	632'623.59	0.06	a)
CND10004R6Q6	2.6100 % EXIMCH 2.61 01/27/27 2205	2'000	0	0	2'000 CNY	101.03%	246'929.18	0.02	a)
CND10004R999	2.7500 % CGB 2 3/4 02/17/32 INBK	2'000	0	0	2'000 CNY	102.60%	250'771.45	0.02	a)
CND10004SDM2	2.7400 % ADBCH 2.74 02/23/27 2202	2'000	0	0	2'000 CNY	101.47%	248'021.74	0.02	a)
CND10004SF89	2.6500 % SDBC 2.65 02/24/27 2203	3'000	0	0	3'000 CNY	101.28%	371'314.01	0.03	a)
CND10004SGM5	2.9100 % ADBCH 2.91 02/21/29	2'000	0	0	2'000 CNY	102.40%	250'289.94	0.02	a)
CND10004SKD6	2.9900 % SDBC 2.99 03/01/29 2204	2'000	0	0	2'000 CNY	102.78%	251'204.07	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND10004SWF6	2.6100 % ADBCH 2.61 03/09/25 2203	2'000	0	0	2'000 CNY	100.68%	246'073.72	0.02	a)
CND10004T1Y9	3.1800 % EXIMCH 3.18 03/11/32 2210	4'000	0	0	4'000 CNY	104.76%	512'082.25	0.05	a)
CND10004T3K4	2.5900 % SDBC 2.59 03/17/25 2202	2'000	0	0	2'000 CNY	100.68%	246'083.49	0.02	a)
CND10004THF5	2.9800 % SDBC 2.98 04/22/32 2210	4'000	1'000	0	5'000 CNY	103.44%	632'073.64	0.06	a)
CND100054BC8	3.0600 % ADBCH 3.06 06/06/32 2205	4'000	0	0	4'000 CNY	103.87%	507'756.03	0.05	a)
CND100054QC6	2.5700 % EXIMCH 2.57 06/10/25 2203	1'000	1'000	0	2'000 CNY	100.60%	245'895.29	0.02	a)
CND100058Q29	2.6900 % SDBC 2.69 06/16/27 2208	5'000	0	0	5'000 CNY	101.41%	619'669.38	0.06	a)
CND100058VQ7	2.8200 % EXIMCH 2.82 06/17/27 2215	3'000	1'000	0	4'000 CNY	101.68%	497'045.59	0.05	a)
CND10005CWX0	3.4000 % CGB 3.4 07/15/2072 INBK	0	2'000	0	2'000 CNY	120.98%	295'705.44	0.03	a)
CND10005G4Z4	2.9600 % SDBC 2.96 07/18/32 2215	5'000	0	0	5'000 CNY	103.42%	631'945.32	0.06	a)
CND10005H377	2.4600 % ADBCH 2.46 07/27/25 2206	2'000	0	0	2'000 CNY	100.44%	245'496.89	0.02	a)
CND10005JNG9	2.8300 % ADBCH 2.83 08/11/29	1'000	2'000	0	3'000 CNY	102.16%	374'547.68	0.03	a)
CND10005KVM8	2.9000 % EXIMCH 2.9 08/19/32 2211	4'000	1'000	0	5'000 CNY	102.87%	628'572.34	0.06	a)
CND10005LBD7	2.5000 % ADBCH 2 1/2 08/24/27 2207	2'000	1'000	0	3'000 CNY	100.68%	369'106.91	0.03	a)
CND10005LHT0	2.2200 % SDBC 2.22 08/25/25 2207	1'000	0	0	1'000 CNY	100.18%	122'425.81	0.01	a)
CND10005RB00	2.9700 % ADBCH 2.97 10/14/32 2210	2'000	2'000	0	4'000 CNY	103.40%	505'468.27	0.05	a)
CND10005S515	2.7700 % SDBC 2.77 10/24/32 2220	3'000	3'000	0	6'000 CNY	102.02%	748'068.79	0.07	a)
CND10005X234	2.6000 % ADBCH 2.6 12/01/25 2212	0	2'000	0	2'000 CNY	100.75%	246'242.37	0.02	a)
CND10005X8M2	2.6400 % EXIMCH 2.64 12/05/25 2213	0	1'000	0	1'000 CNY	100.83%	123'225.06	0.01	a)
CND10005ZT22	2.5900 % SDBC 2.59 01/11/26 2302	0	4'000	0	4'000 CNY	100.83%	492'870.91	0.05	a)
CND10005ZV06	2.7300 % SDBC 2.73 01/11/28 2303	0	4'000	0	4'000 CNY	101.67%	496'996.71	0.05	a)
CND10005ZX46	2.8700 % SDBC 2.87 01/09/30	0	2'000	0	2'000 CNY	102.31%	250'074.86	0.02	a)
CND1000620N9	2.8700 % EXIMCH 2.87 02/06/28 2305	0	3'000	0	3'000 CNY	102.04%	374'111.39	0.03	a)
CND100063JL3	3.1000 % EXIMCH 3.1 02/13/33 2310	0	5'000	0	5'000 CNY	104.61%	639'216.79	0.06	a)
CND100064F16	3.1000 % ADBCH 3.1 02/27/33 2302	0	3'000	0	3'000 CNY	104.59%	383'471.41	0.04	a)
CND1000651J2	3.0200 % SDBC 3.02 03/06/33 2305	0	4'000	0	4'000 CNY	104.13%	509'002.57	0.05	a)
CND1000651K0	2.9000 % ADBCH 2.9 03/08/28 2303	0	1'000	0	1'000 CNY	102.20%	124'895.66	0.01	a)
CND100067586	3.2700 % CGB 3.27 03/25/2073 INBK	0	5'000	0	5'000 CNY	118.42%	723'620.78	0.07	a)
CND100067KG2	3.0100 % ADBCH 3.01 03/16/30 2301	0	2'000	0	2'000 CNY	103.08%	251'956.88	0.02	a)
CND100068GV7	2.5800 % ADBCH 2.58 03/23/25 2302	0	1'000	0	1'000 CNY	100.63%	122'973.31	0.01	a)
CND10006BBX4	2.6400 % EXIMCH 2.64 04/14/26 2303	0	2'000	0	2'000 CNY	100.94%	246'706.76	0.02	a)
CND10006DQZ3	2.5500 % ADBCH 2.55 05/11/26 2305	0	2'000	0	2'000 CNY	100.77%	246'303.47	0.02	a)
CND10006GVP7	2.8200 % SDBC 2.82 05/22/33 2310	0	5'000	0	5'000 CNY	102.77%	627'949.07	0.06	a)
CND10006GRG4	2.5200 % SDBC 2.52 05/25/28 2308	0	4'000	0	4'000 CNY	100.98%	493'633.50	0.05	a)
CND10006JDR5	2.6300 % ADBCH 2.63 06/07/28 2307	0	2'000	0	2'000 CNY	101.19%	247'315.37	0.02	a)
CND10006JTY7	2.2700 % ADBCH 2.27 06/08/25 2303	0	1'000	0	1'000 CNY	100.22%	122'474.69	0.01	a)
CND10006KTX7	2.8300 % ADBCH 2.83 06/16/33 2310	0	4'000	0	4'000 CNY	102.56%	501'332.70	0.05	a)
CND10006NGN9	2.2500 % SDBC 2 1/4 07/06/26 2307	0	2'000	0	2'000 CNY	100.15%	244'773.41	0.02	a)
CND10006NHN7	2.8500 % EXIMCH 2.85 07/07/33 2311	0	3'000	0	3'000 CNY	102.72%	376'615.46	0.03	a)
CND10006VBH5	2.5000 % EXIMCH 2 1/2 08/04/28 2315	0	1'000	0	1'000 CNY	100.70%	123'061.30	0.01	a)
CND10006XGW9	2.1500 % ADBCH 2.15 08/24/25 2312	0	1'000	0	1'000 CNY	100.03%	122'246.16	0.01	a)
CND10006YXS0	2.3500 % ADBCH 2.35 09/07/26 2313	0	2'000	0	2'000 CNY	100.33%	245'232.92	0.02	a)
CND10006ZG38	2.6900 % SDBC 2.69 09/11/33 2315	0	2'000	0	2'000 CNY	101.55%	248'200.16	0.02	a)
CND10006ZGB8	2.5700 % ADBCH 2.57 09/13/28 2315	0	1'000	0	1'000 CNY	101.00%	123'432.82	0.01	a)
CND100072G80	2.8500 % ADBCH 2.85 10/20/33 2320	0	2'000	0	2'000 CNY	102.77%	251'196.74	0.02	a)
CNY							60'227'135.83	5.51	
CZ0001001796	4.2000 % CZGB 4.2 12/04/36 49	1'300	0	0	1'300 CZK	102.92%	50'379.33	0.00	a)
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	600	0	0	600 CZK	111.11%	25'103.21	0.00	a)
CZ0001003859	2.5000 % CZGB 2 1/2 08/25/28 78	2'840	0	0	2'840 CZK	95.23%	101'834.95	0.01	a)
CZ0001004253	2.4000 % CZGB 2.4 09/17/25 89	3'150	0	0	3'150 CZK	97.86%	116'076.10	0.01	a)
CZ0001004469	1.0000 % CZGB 1 06/26/26 95	3'100	0	0	3'100 CZK	93.97%	109'692.94	0.01	a)
CZ0001004477	0.9500 % CZGB 0.95 05/15/30 94	3'900	0	0	3'900 CZK	85.17%	125'073.59	0.01	a)
CZ0001005037	0.2500 % CZGB 0 1/4 02/10/27 100	3'100	500	0	3'600 CZK	90.58%	122'787.36	0.01	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	2'900	0	0	2'900 CZK	85.74%	93'622.58	0.01	a)
CZ0001005375	2.7500 % CZGB 2 3/4 07/23/29 105	3'450	0	0	3'450 CZK	95.55%	124'118.45	0.01	a)
CZ0001005870	1.2500 % CZGB 1 1/4 02/14/25 120	4'600	0	0	4'600 CZK	97.16%	168'279.91	0.02	a)
CZ0001005888	1.2000 % CZGB 1.2 03/13/31 121	2'700	3'000	0	5'700 CZK	84.75%	181'892.00	0.02	a)
CZ0001005920	1.5000 % CZGB 1 1/2 04/24/40 125	2'500	500	0	3'000 CZK	70.89%	80'079.55	0.01	a)
CZ0001006076	0.0500 % CZGB 0.05 11/29/29 130	800	6'000	0	6'800 CZK	81.77%	209'379.15	0.02	a)
CZ0001006233	1.7500 % CZGB 1 3/4 06/23/32 138	2'500	1'500	0	4'000 CZK	85.81%	129'246.05	0.01	a)
CZK							1'637'565.17	0.15	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DK0002043744	1.0000 % NDAFH 1 10/01/24 SDRO	500	0	0	500 DKK	98.45%	62'928.20	0.01	a)
DK0002047810	1.0000 % NDAFH 1 04/01/26	1'000	0	0	1'000 DKK	95.75%	122'404.92	0.01	a)
DK0002051929	1.0000 % NDAFH 1 04/01/27 CC2	1'000	0	0	1'000 DKK	94.13%	120'323.81	0.01	a)
DK0009296543	1.0000 % RDKRE 1 01/01/26 10F	1'500	0	0	1'500 DKK	95.95%	183'979.38	0.02	a)
DK0009507931	2.0000 % NYKRE 2 01/01/26 13H	0	700	0	700 DKK	97.80%	87'513.37	0.01	a)
DK0009515363	1.0000 % NYKRE 1 01/01/28 13H	0	500	0	500 DKK	92.81%	59'323.32	0.01	a)
DK0009521841	1.0000 % NYKRE 1 07/01/24 13H	800	0	800	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009531485	1.0000 % NYKRE 1 07/01/26 13H	1'000	0	0	1'000 DKK	95.21%	121'709.51	0.01	a)
DK0009534315	1.0000 % NYKRE 1 07/01/27 13H	0	500	0	500 DKK	93.77%	59'936.28	0.01	a)
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	430	0	430	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	2'760	0	0	2'760 DKK	124.70%	439'978.47	0.04	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	1'300	0	0	1'300 DKK	98.15%	163'099.82	0.01	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	1'150	0	0	1'150 DKK	93.10%	136'862.61	0.01	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	1'650	0	0	1'650 DKK	90.00%	189'840.00	0.02	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	600	300	0	900 DKK	54.08%	62'214.13	0.01	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	0	1'000	0	1'000 DKK	83.36%	106'558.78	0.01	a)
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	0	600	0	600 DKK	97.93%	75'110.40	0.01	a)
DKK							1'991'783.00	0.18	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	161	40	0	201 EUR	110.87%	212'356.48	0.02	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	248	70	0	318 EUR	111.91%	339'094.11	0.03	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	141	60	0	201 EUR	103.56%	198'351.84	0.02	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	54	40	0	94 EUR	115.14%	103'127.61	0.01	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	129	40	0	169 EUR	100.63%	162'053.44	0.01	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	125	60	0	185 EUR	95.58%	168'488.17	0.02	a)
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	175	30	205	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	235	40	0	275 EUR	97.05%	254'304.80	0.02	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	270	50	0	320 EUR	94.85%	289'219.16	0.03	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	162	40	0	202 EUR	74.14%	142'702.63	0.01	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	45	0	0	45 EUR	60.19%	25'808.04	0.00	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	210	50	0	260 EUR	93.19%	230'868.02	0.02	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	105	30	0	135 EUR	75.69%	97'363.19	0.01	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	185	60	0	245 EUR	92.65%	216'285.71	0.02	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	230	40	0	270 EUR	89.75%	230'904.89	0.02	a)
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	180	100	0	280 EUR	85.08%	226'986.35	0.02	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	150	40	0	190 EUR	58.01%	105'022.23	0.01	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	80	0	0	80 EUR	45.83%	34'936.52	0.00	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	70	40	0	110 EUR	60.34%	63'246.68	0.01	a)
AT0000A2NWX8	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	220	100	0	320 EUR	82.58%	251'789.90	0.02	a)
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	75	0	0	75 EUR	45.16%	32'273.45	0.00	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	160	20	0	180 EUR	96.39%	165'322.03	0.02	a)
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	110	40	0	150 EUR	71.20%	101'762.23	0.01	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	110	70	0	180 EUR	88.27%	151'401.54	0.01	a)
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	210	40	0	250 EUR	86.38%	205'772.78	0.02	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	50	50	0	100 EUR	78.47%	74'769.90	0.01	a)
AT0000A2YD59	2.5000 % RFLBOB 2 1/2 06/28/29	0	100	0	100 EUR	96.13%	91'604.49	0.01	a)
AT0000A306J4	2.5000 % ERSTBK 2 1/2 09/19/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.84%	91'323.39	0.01	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	60	40	0	100 EUR	97.98%	93'367.33	0.01	a)
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	0	310	0	310 EUR	100.24%	296'090.98	0.03	a)
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	60	0	60 EUR	100.92%	57'700.71	0.01	a)
AT0000A335K7	3.1500 % RAGB 3.15 10/20/53	0	70	0	70 EUR	100.61%	67'106.05	0.01	a)
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	0	80	0	80 EUR	104.04%	79'307.34	0.01	a)
AT0000B049796	0.2500 % BACA 0 1/4 06/21/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.46%	79'526.69	0.01	a)
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	336	80	0	416 EUR	110.53%	438'148.28	0.04	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	331	80	0	411 EUR	118.70%	464'878.66	0.04	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	293	30	0	323 EUR	113.10%	348'106.84	0.03	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	185	50	0	235 EUR	103.04%	230'739.47	0.02	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	155	20	0	175 EUR	108.54%	180'998.77	0.02	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	167	40	0	207 EUR	106.42%	209'908.14	0.02	a)
BE0000332412	2.6000 % BGB 2.6 06/22/24 72	242	20	262	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	170	20	0	190 EUR	100.48%	181'909.63	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	380	60	0	440 EUR	96.88%	406'170.73	0.04	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	288	70	0	358 EUR	88.37%	301'458.57	0.03	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	135	50	0	185 EUR	85.61%	150'916.24	0.01	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	270	60	0	330 EUR	95.80%	301'231.97	0.03	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	175	40	0	215 EUR	72.02%	147'539.13	0.01	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	140	40	0	180 EUR	75.30%	129'158.96	0.01	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	257	80	0	337 EUR	93.82%	301'282.80	0.03	a)
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	222	0	222	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	115	20	0	135 EUR	77.65%	99'887.10	0.01	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	130	0	0	130 EUR	82.05%	101'644.26	0.01	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	270	80	0	350 EUR	92.35%	308'002.40	0.03	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	175	60	0	235 EUR	87.43%	195'768.70	0.02	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	320	70	0	390 EUR	91.20%	338'921.56	0.03	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	185	50	0	235 EUR	71.21%	159'454.36	0.01	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	210	60	0	270 EUR	84.91%	218'444.89	0.02	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	130	60	0	190 EUR	64.45%	116'690.77	0.01	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	160	50	0	210 EUR	90.58%	181'249.57	0.02	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	240	50	0	290 EUR	81.05%	223'964.95	0.02	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	90	30	0	120 EUR	42.20%	48'257.44	0.00	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	270	60	0	330 EUR	81.82%	257'274.80	0.02	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	170	30	0	200 EUR	63.74%	121'477.38	0.01	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	70	40	0	110 EUR	94.92%	99'487.22	0.01	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	110	260	0	370 EUR	100.91%	355'771.68	0.03	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	0	230	0	230 EUR	97.81%	214'354.74	0.02	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	0	100	0	100 EUR	101.84%	97'038.78	0.01	a)
BE0002470459	2.8750 % FLUVIU 2 7/8 05/07/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.52%	91'968.49	0.01	a)
BE0002483585	0.7500 % CCBGBB 0 3/4 02/10/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.17%	92'587.87	0.01	a)
BE0002594720	0.6250 % INGB 0 5/8 05/30/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.39%	91'850.33	0.01	a)
BE0002709906	1.0500 % WALLOO 1.05 06/22/40 EMTN	100	0	0	100 EUR	68.26%	65'047.63	0.01	a)
BE0002717982	1.0000 % FLEMSH 1 01/23/51 EMTN	100	0	0	100 EUR	56.11%	53'465.33	0.00	a)
BE0002718998	0.0100 % FLEMSH 0.01 06/23/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.42%	86'158.76	0.01	a)
BE0002736172	0.1250 % FLEMSH 0 1/8 10/15/35 EMTN	100	0	0	100 EUR	69.73%	66'444.56	0.01	a)
BE0002816974	0.3750 % WALLOO 0 3/8 10/22/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.18%	77'358.88	0.01	a)
BE0002924059	3.1250 % KBC 3 1/8 02/22/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.64%	94'945.30	0.01	a)
BE0002933142	3.7500 % LCFB 3 3/4 06/22/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.47%	98'591.98	0.01	a)
BE0002934157	3.2500 % FLEMSH 3 1/4 04/05/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.39%	95'659.96	0.01	a)
BE0002963446	4.1250 % CCBGBB 4 1/8 09/12/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.51%	97'677.22	0.01	a)
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	0	100	0	100 EUR	102.07%	97'264.62	0.01	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	150	30	0	180 EUR	86.25%	147'936.86	0.01	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	130	0	0	130 EUR	95.53%	118'340.11	0.01	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	220	0	0	220 EUR	52.16%	109'341.08	0.01	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	150	40	0	190 EUR	84.30%	152'630.57	0.01	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	80	110	40	150 EUR	95.96%	137'159.46	0.01	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	0	150	0	150 EUR	85.07%	121'586.97	0.01	a)
DE0001053528	0.1500 % BAYERN 0.15 04/03/30	50	0	0	50 EUR	85.17%	40'576.16	0.00	a)
DE0001053551	0.0100 % BAYERN 0.01 05/07/27	100	0	0	100 EUR	91.22%	86'919.16	0.01	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	555	0	555	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	525	140	0	665 EUR	98.94%	626'931.56	0.06	a)
DE0001102358	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/24	365	0	365	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	375	0	375	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	490	60	0	550 EUR	97.31%	510'003.67	0.05	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	515	30	0	545 EUR	97.02%	503'866.44	0.05	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	550	120	0	670 EUR	95.55%	609'996.11	0.06	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	553	150	50	653 EUR	93.62%	582'559.28	0.05	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	500	110	0	610 EUR	93.36%	542'640.02	0.05	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	535	130	0	665 EUR	93.38%	591'712.33	0.05	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	580	140	0	720 EUR	76.70%	526'199.74	0.05	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	480	70	0	550 EUR	92.67%	485'691.33	0.04	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	470	100	0	570 EUR	90.93%	493'869.55	0.05	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	520	20	0	540 EUR	90.12%	463'718.79	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	490	150	0	640 EUR	88.03%	536'846.87	0.05	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	540	290	0	830 EUR	51.99%	411'169.56	0.04	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	470	130	0	600 EUR	87.08%	497'885.38	0.05	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	560	130	0	690 EUR	86.13%	566'269.43	0.05	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	440	50	0	490 EUR	76.27%	356'128.44	0.03	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	380	80	0	460 EUR	91.24%	399'920.20	0.04	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	450	130	0	580 EUR	85.19%	470'827.11	0.04	a)
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	420	100	0	520 EUR	74.21%	367'700.16	0.03	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	440	130	0	570 EUR	89.41%	485'640.92	0.04	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	530	100	0	630 EUR	84.25%	505'790.69	0.05	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	330	270	0	600 EUR	49.60%	283'549.51	0.03	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	560	80	0	640 EUR	83.23%	507'586.49	0.05	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	210	200	0	410 EUR	81.76%	319'433.48	0.03	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	440	110	0	550 EUR	95.06%	498'185.54	0.05	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	100	370	0	470 EUR	84.92%	380'305.19	0.03	a)
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	140	430	40	530 EUR	98.42%	497'058.85	0.05	a)
DE0001104875	0.0000 % BKO 0 03/15/24	160	0	160	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104891	0.4000 % BKO 0.4 09/13/24	210	100	310	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104909	2.2000 % BKO 2.2 12/12/24	180	110	0	290 EUR	98.99%	273'545.18	0.03	a)
DE0001134922	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/24	155	0	155	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	225	20	0	245 EUR	112.24%	262'040.83	0.02	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	285	60	0	345 EUR	111.18%	365'481.99	0.03	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	245	30	0	275 EUR	109.19%	286'119.43	0.03	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	192	20	0	212 EUR	120.64%	243'714.48	0.02	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	372	60	0	432 EUR	119.45%	491'727.16	0.05	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	383	110	0	493 EUR	121.15%	569'118.78	0.05	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	469	110	0	579 EUR	116.31%	641'704.92	0.06	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	305	110	0	415 EUR	121.21%	479'332.69	0.04	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	354	60	0	414 EUR	128.84%	508'281.49	0.05	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	320	90	0	410 EUR	109.65%	428'398.64	0.04	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	507	90	0	597 EUR	98.76%	561'823.06	0.05	a)
DE0001141794	0.0000 % OBL 0 04/05/24 179	390	0	390	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141802	0.0000 % OBL 0 10/18/24 180	410	50	460	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	390	40	0	430 EUR	96.50%	395'382.57	0.04	a)
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	400	180	0	580 EUR	95.39%	527'177.58	0.05	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	470	120	0	590 EUR	94.31%	530'211.95	0.05	a)
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	410	60	0	470 EUR	93.31%	417'907.11	0.04	a)
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	380	100	0	480 EUR	92.31%	422'197.47	0.04	a)
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	440	180	0	620 EUR	95.83%	566'157.76	0.05	a)
DE0001789345	0.4000 % SAXONY 0.4 05/12/36 135	100	0	0	100 EUR	74.00%	70'514.32	0.01	a)
DE000A0Z1UQ7	0.6250 % BYLABO 0 5/8 11/22/27	80	0	0	80 EUR	91.78%	69'964.51	0.01	a)
DE000A11QE86	0.2500 % BRABUR 0 1/4 10/19/26	50	0	0	50 EUR	93.10%	44'356.72	0.00	a)
DE000A11QJ16	0.5000 % BREMEN 0 1/2 03/03/25 EMTN	40	0	0	40 EUR	97.05%	36'991.31	0.00	a)
DE000A11QTD2	0.6250 % KFW 0 5/8 01/15/25	120	0	0	120 EUR	97.52%	111'512.51	0.01	a)
DE000A11QTF7	0.3750 % KFW 0 3/8 04/23/30 EMTN	0	50	0	50 EUR	86.47%	41'196.96	0.00	a)
DE000A11QTK7	1.3750 % KFW 1 3/8 07/31/35 EMTN	30	0	0	30 EUR	84.99%	24'294.81	0.00	a)
DE000A13R6Z9	0.5000 % BERGER 0 1/2 02/10/25 459	70	0	0	70 EUR	97.20%	64'835.52	0.01	a)
DE000A13R9M1	0.3750 % LBANK 0 3/8 04/13/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	94.37%	44'963.71	0.00	a)
DE000A14JZH9	0.0100 % BADWUR 0.01 04/08/25	100	0	0	100 EUR	96.31%	91'767.43	0.01	a)
DE000A14JZL1	0.0100 % BADWUR 0.01 07/09/32	50	0	0	50 EUR	79.31%	37'784.68	0.00	a)
DE000A14JZP2	0.0100 % BADWUR 0.01 09/02/30	0	50	0	50 EUR	83.51%	39'789.55	0.00	a)
DE000A14KKM9	0.3750 % DZHYP 0 3/8 03/31/26 EMTN	40	0	0	40 EUR	94.18%	35'897.02	0.00	a)
DE000A168023	1.0000 % BERGER 1 05/19/32 488	150	0	0	150 EUR	86.62%	123'803.85	0.01	a)
DE000A168502	1.4500 % HAMBURG 1.45 11/05/38	50	0	0	50 EUR	81.06%	38'620.84	0.00	a)
DE000A168528	0.8000 % HAMBURG 0.8 04/11/34	50	0	0	50 EUR	81.69%	38'918.14	0.00	a)
DE000A1685U2	0.2500 % HAMBURG 0 1/4 01/20/25	60	0	0	60 EUR	97.13%	55'534.42	0.01	a)
DE000A1685X6	1.2000 % HAMBURG 1.2 06/03/33 15Y	50	0	0	50 EUR	86.77%	41'339.89	0.00	a)
DE000A168Y48	1.2500 % KFW 1 1/4 07/04/36 EMTN	70	0	0	70 EUR	82.35%	54'925.63	0.01	a)
DE000A168Y55	0.3750 % KFW 0 3/8 03/09/26	100	0	0	100 EUR	94.82%	90'348.59	0.01	a)
DE000A1KRJS2	1.2500 % INGDI 1 1/4 10/09/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.76%	80'767.35	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000A1R06C5	2.3750 % PBBGR 2 3/8 05/29/28 EMTN	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1R0709	1.5000 % KFW 1 1/2 06/11/24	90	0	90	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQB11	1.3750 % HESSEN 1 3/8 06/10/24 EMTN	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQC69	0.6250 % HESSEN 0 5/8 04/07/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	93.12%	44'366.73	0.00	a)
DE000A1RQCY2	0.3750 % HESSEN 0 3/8 07/06/26 1605	50	0	0	50 EUR	93.96%	44'765.98	0.00	a)
DE000A1RQDB8	1.3000 % HESSEN 1.3 10/10/33 1803	50	0	0	50 EUR	86.97%	41'435.18	0.00	a)
DE000A1RQDR4	0.0000 % HESSEN 0 03/10/25 2001	100	0	0	100 EUR	96.52%	91'968.49	0.01	a)
DE000A1RQDW4	0.0100 % HESSEN 0.01 03/11/30 2006	100	0	0	100 EUR	84.71%	80'720.66	0.01	a)
DE000A1RQDY0	0.0000 % HESSEN 0 09/22/27 2008	0	60	0	60 EUR	90.24%	51'595.20	0.00	a)
DE000A1RQEH3	2.8750 % HESSEN 2 7/8 01/10/33 2301	0	50	0	50 EUR	100.28%	47'777.57	0.00	a)
DE000A1RQEN1	3.2500 % HESSEN 3 1/4 10/05/28	0	40	0	40 EUR	101.55%	38'707.27	0.00	a)
DE000A254PM6	0.0000 % KFW 0 02/18/25 EMTN	90	0	0	90 EUR	96.70%	82'929.44	0.01	a)
DE000A254PP9	0.0000 % KFW 0 03/31/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.55%	87'234.57	0.01	a)
DE000A254PS3	0.0100 % KFW 0.01 03/31/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.38%	91'835.09	0.01	a)
DE000A289C48	0.0100 % NIESA 0.01 06/16/28	100	0	0	60 EUR	88.51%	50'603.82	0.00	a)
DE000A289CL2	0.0100 % LBANK 0.01 01/20/31 5614	50	0	0	50 EUR	82.54%	39'325.50	0.00	a)
DE000A289F29	0.0000 % KFW 0 12/15/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.87%	85'638.49	0.01	a)
DE000A289KG5	0.0100 % IBB 0.01 07/15/27 216	0	100	0	100 EUR	90.54%	86'276.92	0.01	a)
DE000A289NP0	0.1250 % BRABUR 0 1/8 01/26/46	50	0	0	50 EUR	52.50%	25'015.09	0.00	a)
DE000A289NY2	0.0000 % NIESA 0 09/15/25 895	50	0	0	50 EUR	95.18%	45'345.34	0.00	a)
DE000A289RK2	0.0000 % KFW 0 09/17/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.35%	79'419.97	0.01	a)
DE000A2AAPH7	0.6250 % BERGER 0 5/8 08/25/36 490	35	0	0	35 EUR	75.38%	25'138.59	0.00	a)
DE000A2AAPL9	0.6250 % BERGER 0 5/8 02/08/27 493	60	0	0	60 EUR	93.42%	53'410.45	0.00	a)
DE000A2AAPM7	1.3750 % BERGER 1 3/8 06/05/37 495	90	0	0	90 EUR	81.94%	70'272.20	0.01	a)
DE000A2AASB4	0.3750 % DZHYP 0 3/8 06/06/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.12%	91'590.20	0.01	a)
DE000A2AAWG5	1.4500 % BRABUR 1.45 11/26/38	50	0	0	50 EUR	80.74%	38'469.81	0.00	a)
DE000A2BN3T9	0.0000 % NIESA 0 08/02/24 864	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2BN5X6	0.1000 % LANDER 0.1 10/07/26 51	40	0	0	40 EUR	92.77%	35'360.36	0.00	a)
DE000A2BPJ86	0.6250 % DZHYP 0 5/8 08/30/27 385	100	0	0	100 EUR	91.79%	87'461.35	0.01	a)
DE000A2BPJZ8	0.2000 % THRGN 0.2 10/26/26 EMTN	60	0	0	60 EUR	92.90%	53'112.00	0.00	a)
DE000A2DAJ57	0.1250 % KFW 0 1/8 10/04/24	150	0	0	150 EUR	97.96%	140'013.83	0.01	a)
DE000A2DAJV5	0.2500 % LANDER 0 1/4 03/18/24 52	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2DAR40	1.1250 % KFW 1 1/8 06/15/37 EMTN	30	0	0	30 EUR	79.76%	22'801.74	0.00	a)
DE000A2DAR65	0.6250 % KFW 0 5/8 02/22/27 GMTN	90	0	0	90 EUR	93.57%	80'246.88	0.01	a)
DE000A2E4GS9	0.6250 % NIESA 0 5/8 07/06/27 EMTN	40	0	0	40 EUR	92.62%	35'303.57	0.00	a)
DE000A2G8V17	0.7500 % NIESA 0 3/4 02/15/28 879	50	0	0	50 EUR	92.01%	43'836.45	0.00	a)
DE000A2G8W40	1.2000 % BREMEN 1.2 01/30/34 215	70	0	0	70 EUR	85.25%	56'864.65	0.01	a)
DE000A2G8W65	1.0000 % BREMEN 1 05/27/39 217	70	0	0	70 EUR	74.49%	49'682.86	0.00	a)
DE000A2G9G15	0.3750 % NIESA 0 3/8 01/09/26 878	70	0	0	70 EUR	95.01%	63'375.42	0.01	a)
DE000A2GSCL6	0.5000 % SACHAN 0 1/2 06/25/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	92.30%	43'976.04	0.00	a)
DE000A2GSE59	1.1250 % KFW 1 1/8 09/15/32 EMTN	30	0	0	30 EUR	87.35%	24'969.45	0.00	a)
DE000A2GSFA2	0.5000 % KFW 0 1/2 09/15/27	50	60	0	110 EUR	92.09%	96'526.13	0.01	a)
DE000A2GSM83	0.6250 % LANDER 0 5/8 10/25/27 53	50	0	0	50 EUR	92.15%	43'904.10	0.00	a)
DE000A2GSNR0	0.6250 % KFW 0 5/8 01/07/28	90	0	0	90 EUR	91.97%	78'873.02	0.01	a)
DE000A2GSNW0	0.3750 % KFW 0 3/8 04/23/25	70	0	0	70 EUR	96.63%	64'453.98	0.01	a)
DE000A2GSR47	0.0100 % WIBANK 0.01 05/07/27	100	0	0	100 EUR	91.08%	86'787.67	0.01	a)
DE000A2LQH10	0.2500 % KFW 0 1/4 09/15/25	150	0	0	150 EUR	95.63%	136'683.50	0.01	a)
DE000A2LQHT2	1.1250 % KFW 1 1/8 05/09/33 EMTN	30	0	0	30 EUR	86.24%	24'651.86	0.00	a)
DE000A2LQK98	0.0100 % IBB 0.01 11/22/29 276	100	0	0	100 EUR	85.04%	81'033.20	0.01	a)
DE000A2LQKN9	0.3750 % LANDER 0 3/8 04/17/25 54	50	0	0	50 EUR	96.63%	46'039.04	0.00	a)
DE000A2LQSH4	0.7500 % KFW 0 3/4 06/28/28 GMTN	130	0	0	130 EUR	91.64%	113'523.86	0.01	a)
DE000A2LQSN2	0.7500 % KFW 0 3/4 01/15/29 EMTN	60	60	0	120 EUR	90.68%	103'687.81	0.01	a)
DE000A2LQSP7	0.0000 % KFW 0 04/02/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2NBJ54	0.6250 % LANDER 0 5/8 02/13/29 56	60	0	0	60 EUR	89.88%	51'384.81	0.00	a)
DE000A2NBKT4	1.1250 % NIESA 1 1/8 09/12/33 883	50	0	0	50 EUR	85.45%	40'710.99	0.00	a)
DE000A2TR026	0.1250 % NIESA 0 1/8 03/07/25	50	0	0	50 EUR	96.68%	46'062.38	0.00	a)
DE000A2TR109	0.0100 % IBBSH 0.01 10/17/29 11	100	0	0	100 EUR	85.37%	81'347.65	0.01	a)
DE000A2TR208	0.7500 % SACHAN 0 3/4 01/29/29 10Y	50	0	0	50 EUR	90.48%	43'109.40	0.00	a)
DE000A2TR8W8	0.3750 % NIESA 0 3/8 05/14/29	50	0	0	50 EUR	88.13%	41'990.71	0.00	a)
DE000A2TSB40	0.1250 % NIESA 0 1/8 04/08/27 887	50	0	0	50 EUR	91.65%	43'663.50	0.00	a)
DE000A2TSDV6	0.0500 % DZHYP 0.05 06/29/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.40%	81'378.15	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000A2TSDZ7	0.3750 % DZHYP 0 3/8 11/10/34 EMTN	50	0	0	50 EUR	75.50%	35'971.35	0.00	a)
DE000A2TSTRO	0.8750 % KFW 0 7/8 07/04/39 EMTN	75	0	0	75 EUR	73.70%	52'669.91	0.00	a)
DE000A2TST58	0.0000 % KFW 0 07/04/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2TSTU4	0.0000 % KFW 0 09/30/26 EMTN	100	50	0	150 EUR	92.73%	132'537.03	0.01	a)
DE000A2YNZ16	0.0500 % KFW 0.05 09/29/34 EMTN	50	0	0	50 EUR	74.19%	35'348.64	0.00	a)
DE000A2YPE27	0.2000 % THRGN 0.2 09/12/39	80	0	0	80 EUR	64.66%	49'292.28	0.00	a)
DE000A30V8Q7	2.7500 % NIESA 2 3/4 02/17/31	0	40	0	40 EUR	99.42%	37'893.89	0.00	a)
DE000A30V9J0	3.1250 % KFW 3 1/8 06/07/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.82%	97'019.73	0.01	a)
DE000A30V9M4	2.8750 % KFW 2 7/8 06/07/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.23%	95'506.55	0.01	a)
DE000A30VM78	2.8750 % KFW 2 7/8 12/28/29 EMTN	80	0	0	80 EUR	100.39%	76'527.21	0.01	a)
DE000A30VUG3	2.5000 % KFW 2 1/2 11/19/25 EMTN	0	70	0	70 EUR	98.93%	65'990.80	0.01	a)
DE000A30VUK5	2.7500 % KFW 2 3/4 03/15/28 EMTN	90	30	0	120 EUR	99.70%	113'999.54	0.01	a)
DE000A30WF27	3.0000 % PBBGR 3 01/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.67%	93'066.21	0.01	a)
DE000A30WF68	2.8750 % PBBGR 2 7/8 01/19/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.59%	92'039.01	0.01	a)
DE000A351MM7	2.8750 % KFW 2 7/8 05/29/26 EMTN	0	80	0	80 EUR	99.63%	75'948.62	0.01	a)
DE000A351MT2	3.1250 % KFW 3 1/8 10/10/28 EMTN	0	90	0	90 EUR	101.26%	86'841.79	0.01	a)
DE000A3E5LU1	0.0000 % KFW 0 11/09/28 EMTN	120	0	0	120 EUR	87.76%	100'354.63	0.01	a)
DE000A3E5SQ4	3.0000 % BRABUR 3 02/27/32	0	100	0	100 EUR	101.08%	96'318.40	0.01	a)
DE000A3E5XK7	0.0000 % KFW 0 11/15/24 EMTN	30	0	0	30 EUR	97.51%	27'875.84	0.00	a)
DE000A3E5XN1	0.1250 % KFW 0 1/8 01/09/32 EMTN	100	40	0	140 EUR	81.23%	108'358.47	0.01	a)
DE000A3H2W42	0.0100 % NIESA 0.01 08/13/30 898	70	0	0	70 EUR	83.51%	55'700.04	0.01	a)
DE000A3H2XK1	0.0100 % NIESA 0.01 09/08/26 899	100	0	0	100 EUR	92.68%	88'312.28	0.01	a)
DE000A3H2Y08	0.1000 % BERGER 0.1 01/18/41 530	80	0	0	80 EUR	60.70%	46'275.07	0.00	a)
DE000A3H2ZF6	0.0000 % KFW 0 01/10/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.61%	78'714.84	0.01	a)
DE000A3H3D69	0.0000 % SACHAN 0 03/10/31	100	0	0	100 EUR	82.19%	78'317.49	0.01	a)
DE000A3H3E76	0.0000 % KFW 0 06/15/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.40%	133'497.53	0.01	a)
DE000A3H3ETO	0.1250 % THRGN 0 1/8 01/13/51	40	0	0	40 EUR	45.37%	17'293.69	0.00	a)
DE000A3H3F67	0.0100 % LANDER 0.01 02/04/31 60	50	0	0	50 EUR	82.46%	39'285.95	0.00	a)
DE000A3H3GK4	2.7500 % SAARLD 2 3/4 01/18/30	0	50	0	50 EUR	99.65%	47'476.94	0.00	a)
DE000A3H3KE9	0.3750 % KFW 0 3/8 05/20/36 EMTN	30	0	0	30 EUR	73.81%	21'098.84	0.00	a)
DE000A3MP684	1.6250 % DZHYP 1 5/8 05/30/31 1248	0	60	0	60 EUR	90.97%	52'012.00	0.00	a)
DE000A3MP7H9	0.0000 % KFW 0 04/30/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.36%	87'053.52	0.01	a)
DE000A3MP7K3	1.1250 % KFW 1 1/8 03/31/37 EMTN	0	70	0	70 EUR	80.27%	53'540.23	0.00	a)
DE000A3MQNG3	0.1250 % NIESA 0 1/8 01/09/32	0	80	0	80 EUR	81.04%	61'778.86	0.01	a)
DE000A3MQUF0	2.7500 % LBANK 2 3/4 02/16/28 EMTN	0	40	0	40 EUR	99.26%	37'832.90	0.00	a)
DE000A3MQVV5	1.2500 % KFW 1 1/4 06/30/27 EMTN	130	0	0	130 EUR	94.88%	117'536.16	0.01	a)
DE000A3MQYK2	1.2500 % BERGER 1 1/4 06/01/28	80	0	0	80 EUR	93.52%	71'293.97	0.01	a)
DE000A3MQYQ9	2.8750 % BERGER 2 7/8 04/05/29	0	100	0	100 EUR	100.13%	95'412.21	0.01	a)
DE000AAR0249	0.1250 % AARB 0 1/8 02/01/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000AAR0256	0.0100 % AARB 0.01 07/08/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.65%	84'473.11	0.01	a)
DE000AAR0256XXX	0.0100 % AARB 0.01 07/08/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000AAR0397	3.8750 % AARB 3 7/8 05/18/26 EMTN	0	50	0	50 EUR	100.42%	47'843.80	0.00	a)
DE000BHYOGM2	3.0000 % BHH 3 01/10/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.04%	95'325.50	0.01	a)
DE000BHYOMX7	0.7500 % BHH 0 3/4 02/26/26 207	140	0	0	140 EUR	95.15%	126'936.26	0.01	a)
DE000BLB6J02	3.5000 % BYLAN 3 1/2 01/11/27 EMTN	0	40	0	40 EUR	100.88%	38'449.23	0.00	a)
DE000BLB6JF8	0.2500 % BYLAN 0 1/4 09/04/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BLB6JH4	0.7500 % BYLAN 0 3/4 02/05/29 EMTN	0	40	0	40 EUR	89.59%	34'146.00	0.00	a)
DE000BLB6JM4	0.2000 % BYLAN 0.2 05/20/30 EMTN	0	50	0	50 EUR	84.28%	40'154.98	0.00	a)
DE000BLB6JT9	3.1250 % BYLAN 3 1/8 10/19/27 EMTN	0	60	0	60 EUR	100.14%	57'250.76	0.01	a)
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	100	230	0	330 EUR	99.13%	311'718.93	0.03	a)
DE000BU22015	2.8000 % BKO 2.8 06/12/25	0	340	0	340 EUR	99.44%	322'162.82	0.03	a)
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	0	260	0	260 EUR	99.98%	247'690.22	0.02	a)
DE000BU22031	3.1000 % BKO 3.1 12/12/25 2Y	0	300	0	300 EUR	100.15%	286'296.67	0.03	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	80	450	0	530 EUR	98.86%	499'260.77	0.05	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	0	590	0	590 EUR	99.71%	560'565.19	0.05	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	0	260	0	260 EUR	100.10%	247'994.95	0.02	a)
DE000BU2D004	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/54	0	110	0	110 EUR	99.27%	104'049.91	0.01	a)
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	80	750	40	790 EUR	99.44%	748'592.43	0.07	a)
DE000BU2Z015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	0	610	0	610 EUR	101.75%	591'436.70	0.05	a)
DE000BU3Z005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	0	120	0	120 EUR	99.50%	113'775.42	0.01	a)
DE000CZ40LQ7	0.1250 % CMZB 0 1/8 12/15/26 EMTN	35	0	0	35 EUR	91.94%	30'662.83	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000CZ40MQ5	0.8750 % CMZB 0 7/8 04/18/28 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.53%	43'606.33	0.00	a)
DE000CZ40MU7	0.6250 % CMZB 0 5/8 05/28/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.47%	45'962.33	0.00	a)
DE000CZ43ZJ6	2.7500 % CMZB 2 3/4 12/08/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	98.96%	47'148.19	0.00	a)
DE000CZ43ZX7	3.1250 % CMZB 3 1/8 04/20/29 EMTN	0	80	0	80 EUR	100.13%	76'326.72	0.01	a)
DE000CZ45W99	2.2500 % CMZB 2 1/4 09/01/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.02%	89'590.10	0.01	a)
DE000DHY4994	0.2500 % NDB 0 1/4 12/10/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.33%	92'741.28	0.01	a)
DE000DL19S01	0.5000 % DB 0 1/2 06/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.99%	179'128.74	0.02	a)
DE000DL19SH3	0.2500 % DB 0 1/4 03/08/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCB0BV0	3.3750 % HCOB 3 3/8 02/01/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.76%	95'056.79	0.01	a)
DE000HV2ARM0	0.8750 % HVB 0 7/8 01/11/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.15%	85'906.25	0.01	a)
DE000HV2ART5	0.6250 % HVB 0 5/8 11/20/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	95.42%	45'463.97	0.00	a)
DE000HV2AS10	0.2500 % HVB 0 1/4 01/15/32	0	100	0	100 EUR	80.74%	76'931.04	0.01	a)
DE000HV2AYU9	0.5000 % HVB 0 1/2 02/23/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.34%	87'990.20	0.01	a)
DE000LB06CF2	0.8750 % LBBW 0 7/8 09/15/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.18%	91'645.46	0.01	a)
DE000LB1DSM2	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/27/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.83%	46'133.85	0.00	a)
DE000LB2CRG6	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/18/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.65%	84'473.11	0.01	a)
DE000LB2ZV93	1.7500 % LBBW 1 3/4 02/28/28 829	100	0	0	100 EUR	95.14%	90'659.23	0.01	a)
DE000MHB13J7	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 03/14/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.80%	46'121.46	0.00	a)
DE000MHB20J2	0.6250 % MUNHYP 0 5/8 11/10/27	50	0	0	50 EUR	91.55%	43'617.76	0.00	a)
DE000MHB31J9	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 08/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.59%	87'274.59	0.01	a)
DE000MHB34J3	3.1250 % MUNHYP 3 1/8 08/14/29 EMTN	0	50	0	50 EUR	100.52%	47'890.97	0.00	a)
DE000NLB2TD7	0.7500 % NDB 0 3/4 01/18/28 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.44%	43'565.35	0.00	a)
DE000NLB8739	0.6250 % NDB 0 5/8 01/18/27 EMTN	40	0	0	40 EUR	92.95%	35'426.30	0.00	a)
DE000NRW0F26	1.6250 % NRW 1 5/8 10/24/30	30	0	0	30 EUR	92.75%	26'513.98	0.00	a)
DE000NRW0FU3	1.2500 % NRW 1 1/4 03/14/25 1325	45	0	0	45 EUR	97.73%	41'904.67	0.00	a)
DE000NRW0J22	1.0000 % NRW 1 10/16/46 EMTN	70	0	0	70 EUR	65.34%	43'579.64	0.00	a)
DE000NRW0JJ8	1.2500 % NRW 1 1/4 05/12/36 EMTN	80	0	0	80 EUR	82.41%	62'824.74	0.01	a)
DE000NRW0K03	0.9500 % NRW 0.95 03/13/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.68%	88'309.42	0.01	a)
DE000NRW0K52	1.5000 % NRW 1 1/2 06/12/40 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.43%	75'682.76	0.01	a)
DE000NRW0KB3	0.5000 % NRW 0 1/2 02/16/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	93.01%	44'313.84	0.00	a)
DE000NRW0KE7	1.6500 % NRW 1.65 05/16/47 EMTN	50	0	0	50 EUR	75.32%	35'884.16	0.00	a)
DE000NRW0KF4	1.5500 % NRW 1.55 06/16/48 1439	30	0	0	30 EUR	72.91%	20'843.28	0.00	a)
DE000NRW0KM0	1.7500 % NRW 1 3/4 10/26/57 EMTN	100	0	0	100 EUR	70.82%	67'484.15	0.01	a)
DE000NRW0KZ2	1.6500 % NRW 1.65 02/22/38 EMTN	80	0	0	80 EUR	83.92%	63'972.78	0.01	a)
DE000NRW0L10	1.3750 % NRW 1 3/8 01/15/2120 EMTN	100	0	0	100 EUR	51.46%	49'038.24	0.00	a)
DE000NRW0L85	0.2000 % NRW 0.2 03/31/27	100	0	0	100 EUR	91.92%	87'585.23	0.01	a)
DE000NRW0L93	0.0000 % NRW 0 04/02/24	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0LA3	1.7500 % NRW 1 3/4 07/11/68	80	0	0	80 EUR	68.12%	51'929.09	0.00	a)
DE000NRW0LC9	1.9500 % NRW 1.95 09/26/2078 EMTN	20	40	0	60 EUR	70.94%	40'560.82	0.00	a)
DE000NRW0LM8	1.1000 % NRW 1.1 03/13/34 15YR	50	0	0	50 EUR	84.52%	40'268.38	0.00	a)
DE000NRW0LN6	0.2500 % NRW 0 1/4 03/13/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.37%	89'919.79	0.01	a)
DE000NRW0LQ9	2.1500 % NRW 2.15 03/21/2119 EMTN	30	0	0	30 EUR	72.29%	20'665.75	0.00	a)
DE000NRW0LV9	0.8000 % NRW 0.8 07/30/49	50	0	0	50 EUR	58.81%	28'017.15	0.00	a)
DE000NRW0MA1	0.2000 % NRW 0.2 04/09/30	100	0	0	100 EUR	85.52%	81'486.78	0.01	a)
DE000NRW0ME3	0.0000 % NRW 0 05/05/25	100	0	0	100 EUR	96.10%	91'574.95	0.01	a)
DE000NRW0MK0	0.0000 % NRW 0 01/15/29	0	60	0	60 EUR	87.10%	49'799.97	0.00	a)
DE000NRW0MP9	0.9500 % NRW 0.95 01/10/2121 EMTN	50	0	0	50 EUR	43.88%	20'906.74	0.00	a)
DE000NRW0N26	3.4000 % NRW 3.4 03/07/2073 EMTN	0	40	0	40 EUR	106.81%	40'710.99	0.00	a)
DE000NRW0N67	2.9000 % NRW 2.9 06/07/33 EMTN	0	50	0	50 EUR	100.25%	47'763.76	0.00	a)
DE000NRW0NW3	2.7500 % NRW 2 3/4 01/15/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.33%	94'645.14	0.01	a)
DE000NRW0NX1	2.9000 % NRW 2.9 01/15/53 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.24%	89'799.73	0.01	a)
DE000NRW2152	2.3750 % NRW 2 3/8 05/13/33 1250	90	0	0	90 EUR	96.10%	82'416.60	0.01	a)
DE000NBW0584	0.5000 % NRW BK 0 1/2 05/11/26	90	0	0	90 EUR	94.44%	80'986.99	0.01	a)
DE000NBW0AD8	0.3750 % NRW BK 0 3/8 11/17/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	93.06%	44'339.57	0.00	a)
DE000NBW0AF3	0.7500 % NRW BK 0 3/4 06/30/28 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.24%	43'471.97	0.00	a)
DE000NBW0AH9	0.0000 % NRW BK 0 10/15/29 EMTN	50	0	0	50 EUR	85.19%	40'589.02	0.00	a)
DE000NBW0AK3	0.1000 % NRW BK 0.1 07/09/35 EMTN	50	0	0	50 EUR	72.15%	34'374.32	0.00	a)
DE000NBW0AT4	2.8750 % NRW BK 2 7/8 04/05/33 EMTN	0	50	0	50 EUR	99.85%	47'570.32	0.00	a)
DE000NBW0AU2	3.0000 % NRW BK 3 05/31/30 EMTN	0	50	0	50 EUR	100.83%	48'038.66	0.00	a)
DE000NBW17P2	0.2500 % NRW BK 0 1/4 01/20/25 17P	50	0	0	50 EUR	97.07%	46'249.15	0.00	a)
DE000NBW17Y4	0.6250 % NRW BK 0 5/8 11/11/27	50	0	0	50 EUR	91.87%	43'770.22	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000NBW18M7	1.2000 % NRWK 1.2 03/28/39	50	0	0	50 EUR	76.31%	36'358.22	0.00	a)
DE000RLP0645	0.5000 % RHIPAL 0 1/2 01/21/25	50	0	0	50 EUR	97.34%	46'375.88	0.00	a)
DE000RLP0835	0.3750 % RHIPAL 0 3/8 01/26/27	100	0	0	100 EUR	92.72%	88'353.25	0.01	a)
DE000RLP1130	0.2500 % RHIPAL 0 1/4 05/31/29 EMTN	60	0	0	60 EUR	87.53%	50'044.10	0.00	a)
DE000RLP1288	0.3750 % RHIPAL 0 3/8 04/01/41	60	0	0	60 EUR	64.20%	36'707.35	0.00	a)
DE000SCB0005	0.8750 % DKRED 0 7/8 10/02/28	100	0	0	100 EUR	90.90%	86'617.10	0.01	a)
DE000SHFM618	0.6250 % SCHHOL 0 5/8 08/31/28	50	0	0	50 EUR	90.57%	43'149.42	0.00	a)
DE000SHFM667	0.2500 % SCHHOL 0 1/4 02/27/26 7YR	50	0	0	50 EUR	94.46%	45'004.21	0.00	a)
DE000SHFM709	0.2000 % SCHHOL 0.2 08/15/39	50	0	0	50 EUR	64.67%	30'809.10	0.00	a)
DE000SHFM758	0.0100 % SCHHOL 0.01 07/16/25	100	0	0	100 EUR	95.62%	91'118.52	0.01	a)
DE000SHFM774	0.0100 % SCHHOL 0.01 10/22/26	50	0	0	50 EUR	92.45%	44'047.99	0.00	a)
DK0009410185	1.8750 % JYKRE 1 7/8 10/01/29 CCE	0	100	0	100 EUR	93.66%	89'248.96	0.01	a)
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	443	70	0	513 EUR	113.94%	556'991.51	0.05	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	342	80	0	422 EUR	115.33%	463'745.21	0.04	a)
ES00000121G2	4.8000 % SPGB 4.8 01/31/24	252	0	252	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	347	90	0	437 EUR	113.42%	472'304.76	0.04	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	362	130	0	492 EUR	101.88%	477'613.66	0.04	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	385	110	0	495 EUR	106.48%	502'227.81	0.05	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	406	70	0	476 EUR	119.44%	541'724.30	0.05	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	307	120	0	427 EUR	109.54%	445'713.95	0.04	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	300	20	0	320 EUR	120.44%	367'242.78	0.03	a)
ES00000124W3	3.8000 % SPGB 3.8 04/30/24	360	0	360	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	372	0	272	100 EUR	99.39%	94'705.17	0.01	a)
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	355	50	0	405 EUR	98.03%	378'315.19	0.03	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	395	90	0	485 EUR	93.97%	434'299.37	0.04	a)
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	402	130	0	532 EUR	98.45%	499'091.69	0.05	a)
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	400	70	0	470 EUR	97.70%	437'567.95	0.04	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	330	80	0	410 EUR	87.29%	341'006.95	0.03	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	255	50	0	305 EUR	90.69%	263'560.21	0.02	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	430	140	0	570 EUR	95.73%	519'935.00	0.05	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	370	150	0	520 EUR	95.64%	473'885.68	0.04	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	335	90	0	425 EUR	93.16%	377'279.17	0.03	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	363	90	0	453 EUR	107.83%	465'441.90	0.04	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	400	110	0	510 EUR	94.90%	461'166.59	0.04	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	400	170	0	570 EUR	94.07%	510'918.82	0.05	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	280	110	0	390 EUR	83.05%	308'623.01	0.03	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	390	120	0	510 EUR	93.77%	455'689.70	0.04	a)
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	370	70	0	440 EUR	93.00%	389'919.88	0.04	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	370	60	0	430 EUR	85.88%	351'868.20	0.03	a)
ES0000012E85	0.2500 % SPGB 0 1/4 07/30/24 5YR	310	0	310	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	400	120	0	520 EUR	87.83%	435'211.95	0.04	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	420	70	0	490 EUR	86.20%	402'474.21	0.04	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	370	0	370	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	350	120	0	470 EUR	54.02%	241'949.29	0.02	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	380	90	0	470 EUR	93.11%	416'980.05	0.04	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	420	100	0	520 EUR	89.42%	443'090.39	0.04	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	330	50	0	380 EUR	69.67%	252'282.93	0.02	a)
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	370	70	0	440 EUR	94.32%	395'450.03	0.04	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	410	80	0	490 EUR	81.33%	379'740.23	0.03	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	110	30	0	140 EUR	48.72%	64'994.27	0.01	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	360	220	0	580 EUR	89.29%	493'492.20	0.05	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	240	60	0	300 EUR	71.84%	205'371.14	0.02	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	370	80	0	450 EUR	82.62%	354'281.09	0.03	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	110	130	0	240 EUR	64.72%	148'007.18	0.01	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	370	90	0	460 EUR	91.76%	402'212.65	0.04	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	380	370	170	580 EUR	82.84%	457'817.20	0.04	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	310	30	0	340 EUR	95.98%	310'953.10	0.03	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	160	190	0	350 EUR	66.92%	223'184.35	0.02	a)
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	220	340	0	560 EUR	89.30%	476'523.26	0.04	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	340	110	0	450 EUR	95.51%	409'544.51	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	80	170	0	250 EUR	95.99%	228'663.42	0.02	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	0	480	0	480 EUR	99.41%	454'699.18	0.04	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	220	270	0	490 EUR	99.62%	465'129.25	0.04	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	0	210	0	210 EUR	103.16%	206'436.85	0.02	a)
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	0	510	0	510 EUR	102.53%	498'265.58	0.05	a)
ES0000012M51	3.5000 % SPGB 3 1/2 05/31/29	0	140	0	140 EUR	102.57%	136'826.81	0.01	a)
ES0000090847	0.5000 % ANDAL 0 1/2 04/30/31	100	0	0	100 EUR	81.75%	77'901.07	0.01	a)
ES00001010B7	0.4200 % MADRID 0.42 04/30/31	100	0	0	100 EUR	81.74%	77'884.88	0.01	a)
ES0000101263	4.3000 % MADRID 4.3 09/15/26	100	0	0	100 EUR	102.33%	97'506.65	0.01	a)
ES0000101768	0.9970 % MADRID 0.997 09/30/24	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000101909	1.5710 % MADRID 1.571 04/30/29	0	100	0	100 EUR	92.43%	88'072.15	0.01	a)
ES0000106635	1.1250 % BASQUE 1 1/8 04/30/29	100	0	0	100 EUR	90.52%	86'252.14	0.01	a)
ES0001352626	3.7110 % JUNGAL 3.711 07/30/29	0	50	0	50 EUR	102.22%	48'702.35	0.00	a)
ES0200002030	1.2500 % ADIFAL 1 1/4 05/04/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.54%	91'038.48	0.01	a)
ES0312298120	4.7500 % AYTCD 4 3/4 05/25/27 XIII	100	0	0	100 EUR	103.79%	98'896.91	0.01	a)
ES0317046003	3.8750 % CEDTDA 3 7/8 05/23/25 A6	0	100	0	100 EUR	100.02%	95'307.40	0.01	a)
ES0371622020	4.2500 % CEDTDA 4 1/4 04/10/31 A6	100	100	0	200 EUR	106.47%	202'914.61	0.02	a)
ES0413211071	4.0000 % BBVASM 4 02/25/25	100	0	0	100 EUR	100.15%	95'429.36	0.01	a)
ES0413860547	0.6250 % SABSM 0 5/8 06/10/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0413860596	1.0000 % SABSM 1 04/26/27	0	100	0	100 EUR	93.03%	88'642.93	0.01	a)
ES0413900129	3.8750 % SANTAN 3 7/8 02/06/26 12	100	0	0	100 EUR	100.72%	95'975.37	0.01	a)
ES0413900368	1.1250 % SANTAN 1 1/8 11/27/24	100	0	0	100 EUR	98.05%	93'434.03	0.01	a)
ES0413900376	2.0000 % SANTAN 2 11/27/34	100	0	0	100 EUR	88.26%	84'096.72	0.01	a)
ES0413900574	0.1250 % SANTAN 0 1/8 06/04/30	100	0	0	100 EUR	82.24%	78'367.99	0.01	a)
ES0413900848	2.3750 % SANTAN 2 3/8 09/08/27	0	100	0	100 EUR	97.06%	92'484.96	0.01	a)
ES0414950628	4.0000 % CABKSM 4 02/03/25	100	0	0	100 EUR	100.08%	95'360.76	0.01	a)
ES0414950644	4.1250 % CABKSM 4 1/8 03/24/36	50	0	0	50 EUR	107.13%	51'042.15	0.00	a)
ES0440609339	1.2500 % CABKSM 1 1/4 01/11/27	100	0	0	100 EUR	94.21%	89'771.14	0.01	a)
EU000A18Z2D4	0.7500 % EU 0 3/4 04/04/31 EMTN	60	0	0	60 EUR	86.77%	49'609.59	0.00	a)
EU000A19VVY6	0.5000 % EU 0 1/2 04/04/25 EMTN	140	0	0	140 EUR	97.05%	129'464.26	0.01	a)
EU000A19XC51	1.2500 % EU 1 1/4 04/04/33 EMTN	60	0	0	60 EUR	87.19%	49'851.43	0.00	a)
EU000A1G0AT6	3.3750 % EFSF 3 3/8 04/03/37 EMTN	40	50	0	90 EUR	103.01%	88'340.01	0.01	a)
EU000A1G0BJ5	3.0000 % EFSF 3 09/04/34 21Y	40	50	0	90 EUR	100.22%	85'943.89	0.01	a)
EU000A1G0BN7	2.1250 % EFSF 2 1/8 02/19/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G0BQ0	1.7500 % EFSF 1 3/4 06/27/24 EMTN	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G0D05	1.4500 % EFSF 1.45 09/05/40 EMTN	90	0	0	90 EUR	78.35%	67'190.86	0.01	a)
EU000A1G0D62	0.4000 % EFSF 0.4 02/17/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.12%	92'539.27	0.01	a)
EU000A1G0D70	0.9500 % EFSF 0.95 02/14/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.84%	88'466.65	0.01	a)
EU000A1G0D88	0.6250 % EFSF 0 5/8 10/16/26 EMTN	70	0	0	70 EUR	94.13%	62'787.11	0.01	a)
EU000A1G0D96	1.7500 % EFSF 1 3/4 07/17/53	30	0	0	30 EUR	72.89%	20'836.70	0.00	a)
EU000A1G0DB8	2.3500 % EFSF 2.35 07/29/44 EMTN	60	0	0	60 EUR	88.01%	50'319.10	0.00	a)
EU000A1G0DD4	1.2000 % EFSF 1.2 02/17/45 EMTN	70	40	0	110 EUR	70.65%	74'053.33	0.01	a)
EU000A1G0DE2	0.2000 % EFSF 0.2 04/28/25 0000	70	0	0	70 EUR	96.44%	64'324.58	0.01	a)
EU000A1G0DH5	0.4000 % EFSF 0.4 05/31/26 EMTN	60	60	0	120 EUR	94.43%	107'981.51	0.01	a)
EU000A1G0DJ1	1.3750 % EFSF 1 3/8 05/31/47 EMTN	100	0	0	100 EUR	71.55%	68'175.95	0.01	a)
EU000A1G0DL7	1.7000 % EFSF 1.7 02/13/43 EMTN	60	50	0	110 EUR	79.55%	83'385.20	0.01	a)
EU000A1G0DN3	2.0000 % EFSF 2 02/28/56 EMTN	50	0	0	50 EUR	76.71%	36'548.32	0.00	a)
EU000A1G0DQ6	0.3750 % EFSF 0 3/8 10/11/24 EMTN	50	0	0	50 EUR	98.10%	46'737.50	0.00	a)
EU000A1G0DR4	0.7500 % EFSF 0 3/4 05/03/27 EMTN	70	0	0	70 EUR	93.64%	62'459.60	0.01	a)
EU000A1G0DT0	1.2500 % EFSF 1 1/4 05/24/33 EMTN	70	40	0	110 EUR	86.76%	90'940.43	0.01	a)
EU000A1G0DV6	0.5000 % EFSF 0 1/2 07/11/25 EMTN	40	0	0	40 EUR	96.38%	36'735.18	0.00	a)
EU000A1G0DW4	1.8000 % EFSF 1.8 07/10/48 EMTN	70	0	0	70 EUR	76.85%	51'258.36	0.00	a)
EU000A1G0DY0	0.8750 % EFSF 0 7/8 07/26/27 EMTN	110	0	0	110 EUR	93.62%	98'128.79	0.01	a)
EU000A1G0EB6	0.4000 % EFSF 0.4 01/26/26	80	0	0	80 EUR	95.10%	72'496.13	0.01	a)
EU000A1G0EC4	0.0000 % EFSF 0 04/19/24	130	0	130	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G0ED2	0.8750 % EFSF 0 7/8 04/10/35 EMTN	90	0	0	90 EUR	80.07%	68'670.21	0.01	a)
EU000A1G0EE0	0.0500 % EFSF 0.05 10/17/29	100	0	0	100 EUR	85.62%	81'587.78	0.01	a)
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	50	50	0	100 EUR	57.33%	54'626.90	0.01	a)
EU000A1G0EJ9	0.0000 % EFSF 0 10/15/25	140	0	0	140 EUR	95.06%	126'810.86	0.01	a)
EU000A1G0EK7	0.0000 % EFSF 0 10/13/27	50	0	0	50 EUR	90.17%	42'959.79	0.00	a)
EU000A1G0EL5	0.0000 % EFSF 0 01/20/31	100	60	0	160 EUR	82.33%	125'515.32	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EU000A1G0EN1	0.0000 % EFSF 0 07/20/26	100	0	0	100 EUR	93.15%	88'759.18	0.01	a)
EU000A1G0EP6	0.1250 % EFSF 0 1/8 03/18/30	60	0	0	60 EUR	85.12%	48'667.95	0.00	a)
EU000A1G1Q17	3.3750 % EU 3 3/8 04/04/32 EMTN	60	0	0	60 EUR	103.87%	59'383.31	0.01	a)
EU000A1G3OR0	3.3750 % EU 3 3/8 04/04/38 EMTN	30	0	0	30 EUR	102.80%	29'387.50	0.00	a)
EU000A1G6TV9	2.8750 % EU 2 7/8 04/04/28 EMTN	55	0	0	55 EUR	100.17%	52'497.68	0.00	a)
EU000A1GVVF8	3.0000 % EU 3 09/04/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	100.15%	47'717.06	0.00	a)
EU000A1GY6W8	3.7500 % EU 3 3/4 04/04/42 EMTN	45	0	0	45 EUR	107.11%	45'926.79	0.00	a)
EU000A1HBXS7	2.5000 % EU 2 1/2 11/04/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	98.76%	47'054.81	0.00	a)
EU000A1U9894	1.0000 % ESM 1 09/23/25 EMTN	90	0	0	90 EUR	96.67%	82'902.86	0.01	a)
EU000A1U9902	1.7500 % ESM 1 3/4 10/20/45 EMTN	50	0	0	50 EUR	78.40%	37'352.08	0.00	a)
EU000A1U9936	1.8500 % ESM 1.85 12/01/55 EMTN	50	0	0	50 EUR	73.02%	34'789.77	0.00	a)
EU000A1U9944	0.5000 % ESM 0 1/2 03/02/26 EMTN	115	0	0	115 EUR	95.12%	104'234.01	0.01	a)
EU000A1U9951	0.1250 % ESM 0 1/8 04/22/24 EMTN	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1U9969	1.1250 % ESM 1 1/8 05/03/32 EMTN	120	0	0	120 EUR	87.62%	100'187.68	0.01	a)
EU000A1U9977	0.8750 % ESM 0 7/8 07/18/42 EMTN	100	0	0	100 EUR	67.81%	64'615.97	0.01	a)
EU000A1Z6TV6	1.5000 % EU 1 1/2 10/04/35 EMTN	50	0	0	50 EUR	85.46%	40'714.32	0.00	a)
EU000A1Z99A1	1.8000 % ESM 1.8 11/02/46 EMTN	70	50	0	120 EUR	78.89%	90'212.14	0.01	a)
EU000A1Z99B9	0.7500 % ESM 0 3/4 03/15/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.80%	134'067.83	0.01	a)
EU000A1Z99F0	0.7500 % ESM 0 3/4 09/05/28 EUR	100	0	0	100 EUR	91.23%	86'930.60	0.01	a)
EU000A1Z99H6	0.5000 % ESM 0 1/2 03/05/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.28%	85'074.38	0.01	a)
EU000A1Z99J2	0.0000 % ESM 0 03/14/25	50	0	0	50 EUR	96.58%	46'015.21	0.00	a)
EU000A1Z99L8	0.0100 % ESM 0.01 03/04/30	0	50	0	50 EUR	84.64%	40'324.60	0.00	a)
EU000A1Z99M6	0.0000 % ESM 0 12/16/24	80	0	0	80 EUR	97.25%	74'135.85	0.01	a)
EU000A1Z99N4	0.0000 % ESM 0 12/15/26	50	0	0	50 EUR	92.20%	43'927.45	0.00	a)
EU000A1Z99Q7	1.0000 % ESM 1 06/23/27	0	50	0	50 EUR	94.03%	44'801.24	0.00	a)
EU000A1Z99R5	3.0000 % ESM 3 03/15/28 ESM	0	50	0	50 EUR	100.53%	47'898.11	0.00	a)
EU000A1Z99S3	3.0000 % ESM 3 08/23/33	0	50	0	50 EUR	101.06%	48'146.81	0.00	a)
EU000A1ZR7H3	1.3750 % EU 1 3/8 10/04/29 EMTN	40	0	0	40 EUR	92.59%	35'290.99	0.00	a)
EU000A283859	0.0000 % EU 0 10/04/30 SURE	150	80	0	230 EUR	83.48%	182'946.46	0.02	a)
EU000A283867	0.1000 % EU 0.1 10/04/40 SURE	150	0	0	150 EUR	61.40%	87'757.70	0.01	a)
EU000A284451	0.0000 % EU 0 11/04/25 SURE	200	0	0	200 EUR	94.95%	180'950.65	0.02	a)
EU000A284469	0.3000 % EU 0.3 11/04/50 SURE	160	70	0	230 EUR	49.80%	109'138.88	0.01	a)
EU000A285VM2	0.0000 % EU 0 07/04/35 SURE	100	50	0	150 EUR	71.55%	102'268.21	0.01	a)
EU000A287074	0.0000 % EU 0 06/02/28 SURE	170	0	0	170 EUR	88.92%	144'036.80	0.01	a)
EU000A2SCAA6	0.7000 % EFSF 0.7 01/17/53	70	0	0	70 EUR	53.90%	35'949.62	0.00	a)
EU000A2SCAB4	0.8750 % EFSF 0 7/8 09/05/28	50	0	0	50 EUR	91.64%	43'661.12	0.00	a)
EU000A2SCAC2	2.3750 % EFSF 2 3/8 06/21/32	100	0	0	100 EUR	96.15%	91'618.78	0.01	a)
EU000A2SCAD0	1.5000 % EFSF 1 1/2 12/15/25 EMTN	0	50	0	50 EUR	97.18%	46'301.08	0.00	a)
EU000A2SCAE8	2.3750 % EFSF 2 3/8 04/11/28 EMTN	80	0	0	80 EUR	98.00%	74'706.82	0.01	a)
EU000A2SCAF5	2.7500 % EFSF 2 3/4 08/17/26	0	40	0	40 EUR	99.32%	37'855.39	0.00	a)
EU000A2SCAG3	2.8750 % EFSF 2 7/8 02/16/33 EMTN	70	0	0	70 EUR	99.75%	66'533.08	0.01	a)
EU000A2SCAH1	3.0000 % EFSF 3 12/15/28	0	70	0	70 EUR	100.52%	67'045.35	0.01	a)
EU000A2SCAJ7	3.0000 % EFSF 3 07/10/30 EFSF	0	50	0	50 EUR	100.75%	48'002.45	0.00	a)
EU000A2SCAK5	3.3750 % EFSF 3 3/8 08/30/38 EMTN	0	50	0	50 EUR	102.00%	48'595.62	0.00	a)
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	0	60	0	60 EUR	102.89%	58'827.02	0.01	a)
EU000A3K4C42	0.4000 % EU 0.4 02/04/37 NGEU	290	100	0	390 EUR	71.88%	267'127.42	0.02	a)
EU000A3K4D09	2.7500 % EU 2 3/4 12/04/37 SURE	120	0	0	120 EUR	96.03%	109'800.75	0.01	a)
EU000A3K4D41	3.2500 % EU 3 1/4 07/04/34 NGEU	0	260	0	260 EUR	102.30%	253'438.01	0.02	a)
EU000A3K4D74	3.3750 % EU 3 3/8 10/04/38 NGEU	0	245	0	245 EUR	101.61%	237'210.41	0.02	a)
EU000A3K4D82	2.7500 % EU 2 3/4 10/05/26 NGEU	0	170	0	170 EUR	99.38%	160'989.08	0.01	a)
EU000A3K4DA4	0.2500 % EU 0 1/4 10/22/26 EMTN	60	0	0	60 EUR	93.35%	53'368.14	0.00	a)
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	270	110	0	380 EUR	86.14%	311'894.74	0.03	a)
EU000A3K4DE6	1.1250 % EU 1 1/8 06/04/37 SURE	0	50	0	50 EUR	78.77%	37'528.36	0.00	a)
EU000A3K4DG1	1.2500 % EU 1 1/4 02/04/43 NGEU	110	40	0	150 EUR	71.78%	102'598.38	0.01	a)
EU000A3K4DJ5	0.8000 % EU 0.8 07/04/25 NGEU	80	170	0	250 EUR	96.73%	230'428.64	0.02	a)
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	80	170	0	250 EUR	89.18%	212'442.97	0.02	a)
EU000A3K4DS6	2.0000 % EU 2 10/04/27 NGEU	140	170	0	310 EUR	97.01%	286'567.48	0.03	a)
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	50	150	0	200 EUR	84.66%	161'347.93	0.01	a)
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	100	170	0	270 EUR	100.75%	259'205.53	0.02	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	80	100	0	180 EUR	98.83%	169'508.81	0.02	a)
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	130	130	0	260 EUR	93.52%	231'683.11	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EU000A3K4ED6	3.0000 % EIB 3 11/15/28 EARN	0	60	0	60 EUR	100.70%	57'572.07	0.01	a)
EU000A3K4EL9	4.0000 % EU 4 04/04/44 NGEU	0	70	0	70 EUR	109.19%	72'831.07	0.01	a)
EU000A3K4EN5	3.1250 % EU 3 1/8 12/05/28 NGEU	0	90	0	90 EUR	101.07%	86'672.84	0.01	a)
EU000A3K7MW2	1.6250 % EU 1 5/8 12/04/29 NGEU	200	130	0	330 EUR	93.58%	294'251.15	0.03	a)
EU000A3KM903	0.2000 % EU 0.2 06/04/36 SURE	120	50	0	170 EUR	71.39%	115'644.79	0.01	a)
EU000A3KNYF7	0.0000 % EU 0 03/04/26 SURE	90	50	0	140 EUR	94.11%	125'546.20	0.01	a)
EU000A3KNYG5	0.4500 % EU 0.45 05/02/46 SURE	100	0	0	100 EUR	57.48%	54'772.69	0.01	a)
EU000A3KP2Z3	0.2500 % EU 0 1/4 04/22/36 EMTN	150	0	0	150 EUR	72.07%	103'005.74	0.01	a)
EU000A3KRJQ6	0.0000 % EU 0 07/04/29 SURE	140	0	0	140 EUR	86.33%	115'170.06	0.01	a)
EU000A3KRJR4	0.7500 % EU 0 3/4 01/04/47 SURE	70	30	0	100 EUR	61.61%	58'705.24	0.01	a)
EU000A3KSXE1	0.0000 % EU 0 07/04/31 NGEU	320	30	0	350 EUR	81.33%	271'229.68	0.02	a)
EU000A3KT6A3	0.0000 % EU 0 04/22/31 EMTN	80	50	0	130 EUR	82.00%	101'579.85	0.01	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	250	60	0	310 EUR	62.77%	185'430.53	0.02	a)
EU000A3KTGV8	0.0000 % EU 0 07/06/26 NGEU	370	0	0	370 EUR	93.31%	328'973.08	0.03	a)
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	260	0	0	260 EUR	54.54%	135'117.72	0.01	a)
EU000A3KWCF4	0.0000 % EU 0 10/04/28 NGEU	230	150	0	380 EUR	87.90%	318'285.73	0.03	a)
EU000A3LNF05	3.1250 % EU 3 1/8 12/04/30 NGEU	0	130	0	130 EUR	101.59%	125'840.73	0.01	a)
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25	140	0	0	140 EUR	100.98%	134'704.36	0.01	a)
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	65	40	0	105 EUR	100.02%	100'073.77	0.01	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	145	0	0	145 EUR	93.63%	129'364.02	0.01	a)
FI4000079041	2.0000 % RFGB 2 04/15/24	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	130	0	0	130 EUR	87.09%	107'877.64	0.01	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	59	20	0	79 EUR	96.71%	72'798.14	0.01	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	130	0	0	130 EUR	95.09%	117'786.39	0.01	a)
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	90	30	0	120 EUR	72.72%	83'153.56	0.01	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	140	0	0	140 EUR	92.41%	123'283.67	0.01	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34	90	0	0	90 EUR	84.67%	72'613.43	0.01	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	110	30	0	140 EUR	90.57%	120'829.04	0.01	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29	160	0	0	160 EUR	88.59%	135'062.45	0.01	a)
FI4000391529	0.0000 % RFGB 0 09/15/24	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36	85	20	0	105 EUR	71.02%	71'060.47	0.01	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	80	0	0	80 EUR	63.70%	48'558.94	0.00	a)
FI4000441878	0.0000 % RFGB 0 09/15/30	0	90	0	90 EUR	83.75%	71'824.44	0.01	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	80	0	0	80 EUR	46.55%	35'484.61	0.00	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31	70	40	0	110 EUR	82.11%	86'063.28	0.01	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26	50	20	0	70 EUR	93.02%	62'042.71	0.01	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43	0	50	0	50 EUR	62.95%	29'992.00	0.00	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32	120	0	0	120 EUR	90.06%	102'977.73	0.01	a)
FI4000527551	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/27	70	30	0	100 EUR	95.73%	91'221.43	0.01	a)
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38	0	80	0	80 EUR	96.29%	73'402.51	0.01	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33	0	120	0	120 EUR	101.11%	115'612.96	0.01	a)
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	0	60	0	60 EUR	100.54%	57'484.02	0.01	a)
FI4000566294	2.9500 % RFGB 2.95 04/15/55	0	60	0	60 EUR	98.00%	56'028.40	0.01	a)
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	575	200	40	735 EUR	122.03%	854'625.62	0.08	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	495	130	0	625 EUR	104.56%	622'691.42	0.06	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	677	140	0	817 EUR	113.05%	880'085.15	0.08	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	492	120	0	612 EUR	116.79%	681'077.97	0.06	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	342	70	0	412 EUR	112.88%	443'161.13	0.04	a)
FR0010292169	3.8750 % CFF 3 7/8 04/25/55 EMTN	50	0	0	50 EUR	113.34%	54'001.81	0.00	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	444	110	0	554 EUR	110.48%	583'205.20	0.05	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	630	140	0	770 EUR	117.45%	861'717.69	0.08	a)
FR0010775486	5.3750 % CAFFIL 5 3/8 07/08/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010800540	4.6250 % EDF 4 5/8 09/11/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	267	150	0	417 EUR	114.38%	454'491.64	0.04	a)
FR0010891317	4.6250 % EDF 4 5/8 04/26/30 EMTN	50	0	0	50 EUR	105.02%	50'035.43	0.00	a)
FR0010913749	4.0000 % CFF 4 10/24/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	100.88%	48'062.01	0.00	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	738	160	0	898 EUR	101.16%	865'632.38	0.08	a)
FR0011192392	4.0000 % CADES 4 12/15/25	100	0	0	100 EUR	101.05%	96'285.05	0.01	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	913	270	0	1'183 EUR	99.92%	1'126'370.50	0.10	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	500	160	40	620 EUR	100.09%	591'295.77	0.05	a)
FR0011580588	3.0000 % CAFFIL 3 10/02/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.31%	94'631.80	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0011619436	2.2500 % FRTR 2 1/4 05/25/24	625	0	625	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	967	360	50	1'277 EUR	98.81%	1'202'290.93	0.11	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	633	60	520	173 EUR	98.67%	162'656.34	0.01	a)
FR0012159812	1.3750 % CADES 1 3/8 11/25/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	98.22%	140'382.59	0.01	a)
FR0012300754	0.8750 % BNPPCB 0 7/8 11/14/24 EMTN	50	0	0	50 EUR	98.00%	46'688.90	0.00	a)
FR0012447696	0.7500 % CFF 0 3/4 01/21/25	100	0	0	100 EUR	97.44%	92'847.05	0.01	a)
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	760	130	0	890 EUR	96.69%	820'029.14	0.08	a)
FR0012758985	1.1250 % FRPTT 1 1/8 06/04/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.80%	92'241.97	0.01	a)
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	640	110	0	750 EUR	96.57%	690'121.02	0.06	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	989	330	50	1'269 EUR	92.04%	1'112'955.97	0.10	a)
FR0013065117	0.8750 % CMCICB 0 7/8 04/07/26	30	0	0	30 EUR	95.04%	27'168.90	0.00	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	848	200	0	1'048 EUR	94.89%	947'552.26	0.09	a)
FR0013152899	1.0000 % RTEFRA 1 10/19/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.13%	89'692.05	0.01	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	285	50	0	335 EUR	67.68%	216'048.54	0.02	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	795	180	50	925 EUR	82.09%	723'520.06	0.07	a)
FR0013162302	0.5000 % CFF 0 1/2 09/04/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013183167	0.5000 % IDF 0 1/2 06/14/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.06%	91'535.88	0.01	a)
FR0013190188	0.2500 % AGFRNC 0 1/4 07/21/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.11%	88'722.02	0.01	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	675	120	0	795 EUR	93.30%	706'786.95	0.06	a)
FR0013213295	1.0000 % EDF 1 10/13/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.82%	89'396.66	0.01	a)
FR0013213303	1.8750 % EDF 1 7/8 10/13/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.04%	75'312.09	0.01	a)
FR0013220902	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 04/30/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013221389	1.1250 % CAFFIL 1 1/8 12/01/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.41%	82'342.46	0.01	a)
FR0013230703	0.7500 % CAFFIL 0 3/4 01/11/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.27%	88'879.24	0.01	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	515	140	0	655 EUR	83.76%	522'784.74	0.05	a)
FR0013234986	1.3750 % ACACB 1 3/8 02/03/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.75%	83'616.47	0.01	a)
FR0013244415	0.7500 % BPIFRA 0 3/4 11/25/24	100	0	0	100 EUR	97.75%	93'141.49	0.01	a)
FR0013246873	1.2500 % UNEDIC 1 1/4 03/28/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.65%	90'193.27	0.01	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	640	220	30	830 EUR	94.55%	747'805.34	0.07	a)
FR0013252228	1.5000 % UNEDIC 1 1/2 04/20/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.99%	85'747.12	0.01	a)
FR0013255866	1.2500 % CAFFIL 1 1/4 05/11/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.32%	82'253.85	0.01	a)
FR0013256369	1.0000 % BPIFRA 1 05/25/27	100	0	0	100 EUR	93.51%	89'099.36	0.01	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	515	110	0	625 EUR	79.03%	470'682.70	0.04	a)
FR0013264421	1.5000 % CTEFRA 1 1/2 07/29/28	100	0	0	100 EUR	91.41%	87'098.31	0.01	a)
FR0013266434	1.3750 % AGFRNC 1 3/8 07/05/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.95%	82'851.30	0.01	a)
FR0013284908	0.7500 % CMARK 0 3/4 10/05/27	50	0	0	50 EUR	91.83%	43'749.73	0.00	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	945	360	0	1'305 EUR	92.21%	1'146'668.03	0.10	a)
FR0013287299	0.7500 % SOCSFH 0 3/4 10/18/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.83%	87'506.14	0.01	a)
FR0013309549	0.7500 % CFF 0 3/4 01/11/28	100	0	0	100 EUR	91.14%	86'844.84	0.01	a)
FR0013310026	0.5000 % CAFFIL 0 1/2 01/19/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.84%	90'375.27	0.01	a)
FR0013312774	1.0000 % AGFRNC 1 01/31/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.28%	87'932.08	0.01	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	680	260	0	940 EUR	85.50%	765'859.24	0.07	a)
FR0013314036	0.7500 % SFILFR 0 3/4 02/06/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.15%	90'662.09	0.01	a)
FR0013329216	1.3750 % CRLNCB 1 3/8 04/18/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.20%	82'139.50	0.01	a)
FR0013329638	0.5000 % HSBC 0 1/2 04/17/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.56%	92'012.32	0.01	a)
FR0013336492	1.2500 % UNEDIC 1 1/4 05/25/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.38%	82'308.16	0.01	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	955	300	50	1'205 EUR	91.39%	1'049'396.79	0.10	a)
FR0013343340	1.1250 % AFLBNK 1 1/8 06/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.77%	87'448.97	0.01	a)
FR0013344751	0.0000 % FRTR 0 03/25/24	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013345485	1.5000 % CAFFIL 1 1/2 06/28/38	100	0	0	100 EUR	80.08%	76'308.81	0.01	a)
FR0013348802	0.8750 % ACACB 0 7/8 08/11/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.71%	86'439.86	0.01	a)
FR0013349099	2.0000 % FRLBP 2 07/13/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.91%	88'530.49	0.01	a)
FR0013365269	0.7500 % CDCEPS 0 3/4 09/18/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.98%	85'739.49	0.01	a)
FR0013369667	1.0000 % LBPSFH 1 10/04/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.13%	86'837.22	0.01	a)
FR0013372299	1.1250 % SOGRPR 1 1/8 10/22/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.80%	87'472.79	0.01	a)
FR0013373065	1.5000 % AGFRNC 1 1/2 10/31/34 EMRN	100	0	0	100 EUR	84.72%	80'728.28	0.01	a)
FR0013382116	0.6250 % BPIFRA 0 5/8 05/25/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.44%	89'988.40	0.01	a)
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	560	120	0	680 EUR	69.01%	447'170.64	0.04	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	920	280	70	1'130 EUR	89.36%	962'212.68	0.09	a)
FR0013413382	0.3750 % CFF 0 3/8 04/09/27	100	0	0	100 EUR	91.62%	87'305.08	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	820	80	50	850 EUR	96.52%	781'724.09	0.07	a)
FR0013417334	0.8750 % ACACB 0 7/8 05/06/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.12%	76'347.88	0.01	a)
FR0013421799	0.6250 % BPCECB 0 5/8 05/29/31	100	0	0	100 EUR	83.91%	79'960.26	0.01	a)
FR0013422383	1.7000 % SOGRPR 1.7 05/25/50 EMTN	100	0	0	100 EUR	67.94%	64'735.09	0.01	a)
FR0013426368	1.1250 % ADPPF 1 1/8 06/18/34	100	0	0	100 EUR	78.96%	75'235.86	0.01	a)
FR0013426731	0.3500 % RATPPF 0.35 06/20/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.58%	82'497.78	0.01	a)
FR0013431137	0.2500 % AGFRNC 0 1/4 06/29/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.91%	81'858.40	0.01	a)
FR0013445152	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 09/09/49 EMTN	100	0	0	100 EUR	62.06%	59'137.85	0.01	a)
FR0013446598	0.0100 % ACASCF 0.01 09/13/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.98%	82'881.80	0.01	a)
FR0013447638	1.0000 % FRPTT 1 09/17/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.36%	74'671.75	0.01	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	740	250	50	940 EUR	85.85%	768'931.53	0.07	a)
FR0013459047	0.0100 % BPCECB 0.01 11/08/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.87%	87'544.25	0.01	a)
FR0013463775	2.0000 % CNPFP 2 07/27/50	0	100	0	100 EUR	85.99%	81'937.49	0.01	a)
FR0013478898	0.1250 % CMCICB 0 1/8 01/28/30	100	0	0	100 EUR	83.95%	79'991.70	0.01	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	580	100	0	680 EUR	54.11%	350'605.05	0.03	a)
FR0013483914	1.0000 % SOGRPR 1 02/18/70 EMTN	100	0	0	100 EUR	42.32%	40'328.88	0.00	a)
FR0013505096	0.1250 % BPCECB 0 1/8 03/31/25	100	0	0	100 EUR	96.31%	91'770.29	0.01	a)
FR0013505518	0.1250 % BPIFRA 0 1/8 03/25/25	100	0	0	100 EUR	96.31%	91'768.39	0.01	a)
FR0013505575	0.1250 % ACACB 0 1/8 12/16/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.25%	92'666.96	0.01	a)
FR0013506870	0.1250 % CMCICB 0 1/8 04/09/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.22%	91'690.25	0.01	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	770	140	0	910 EUR	94.37%	818'339.49	0.07	a)
FR0013510476	0.1250 % CRH 0 1/8 04/30/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.76%	172'961.67	0.02	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	440	100	0	540 EUR	66.56%	342'489.16	0.03	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	860	280	0	1'140 EUR	83.47%	906'669.49	0.08	a)
FR0013518099	1.0000 % SNCF 1 05/25/40	0	100	0	100 EUR	67.61%	64'425.40	0.01	a)
FR0013518487	0.2500 % UNEDIC 0 1/4 11/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.14%	82'084.23	0.01	a)
FR0013522133	1.0000 % ADPPF 1 01/05/29	100	0	0	100 EUR	89.40%	85'190.63	0.01	a)
FR0013534559XXX	0.0000 % CADES 0 11/25/30	100	0	0	100 EUR	82.36%	78'476.62	0.01	a)
FR0013535820	0.0100 % CAFFIL 0.01 02/22/28	100	0	0	100 EUR	88.27%	84'112.92	0.01	a)
FR00140002P5	0.0000 % CADES 0 02/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.97%	84'780.89	0.01	a)
FR00140005B8	0.0000 % SOGRPR 0 11/25/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.57%	77'729.56	0.01	a)
FR0014000667	0.0000 % UNEDIC 0 11/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.18%	83'072.37	0.01	a)
FR0014000L31	0.0000 % UNEDIC 0 11/19/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.51%	157'241.00	0.01	a)
FR0014000UG9	0.0000 % CADES 0 02/25/26	100	0	0	100 EUR	93.89%	89'466.22	0.01	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072	160	80	0	240 EUR	38.91%	88'990.92	0.01	a)
FR0014001R34	0.7500 % FRLBP 0 3/4 08/02/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.13%	83'973.80	0.01	a)
FR0014001S17	0.0000 % CADES 0 05/25/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.12%	77'301.71	0.01	a)
FR0014002FC5	0.3750 % BPCECB 0 3/8 03/18/41	100	0	0	100 EUR	62.79%	59'828.69	0.01	a)
FR0014002GI0	0.0000 % CADES 0 05/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.97%	81'914.62	0.01	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	270	190	0	460 EUR	59.98%	262'925.68	0.02	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	800	310	0	1'110 EUR	81.04%	857'181.68	0.08	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	700	140	0	840 EUR	92.07%	736'940.57	0.07	a)
FR0014003S98	0.0500 % SFILFR 0.05 06/04/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.34%	81'319.07	0.01	a)
FR0014003U03	0.2500 % BPIFRA 0 1/4 06/04/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.82%	77'967.78	0.01	a)
FR00140045Z3	0.5000 % UNEDIC 0 1/2 05/25/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	73.23%	69'782.51	0.01	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	510	110	0	620 EUR	52.94%	312'763.01	0.03	a)
FR0014004JA7	0.7500 % ALSFR 0 3/4 07/19/41 EMTN	100	0	0	100 EUR	63.30%	60'319.42	0.01	a)
FR0014005FC8	0.1250 % CADES 0 1/8 09/15/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.34%	77'506.58	0.01	a)
FR0014005NA6	0.1250 % AGFRNC 0 1/8 09/29/31	100	0	0	100 EUR	79.67%	75'919.08	0.01	a)
FR0014006UI2	0.0100 % SOCSFH 0.01 12/02/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.73%	87'411.80	0.01	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32	620	110	0	730 EUR	79.81%	555'141.38	0.05	a)
FR0014007RB1	0.4500 % CADES 0.45 01/19/32	100	0	0	100 EUR	82.67%	78'770.10	0.01	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	540	40	0	580 EUR	96.71%	534'500.49	0.05	a)
FR0014009ED1	0.8750 % ACACB 0 7/8 08/31/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.40%	88'041.66	0.01	a)
FR0014009N55	1.3750 % ALSFR 1 3/8 04/13/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.08%	82'978.99	0.01	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	120	180	0	300 EUR	78.72%	225'041.51	0.02	a)
FR001400A2T9	1.7500 % SOCSFH 1 3/4 05/05/34	100	0	0	100 EUR	87.75%	83'615.52	0.01	a)
FR001400A3H2	1.5000 % CADES 1 1/2 05/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.62%	85'393.60	0.01	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	630	390	30	990 EUR	92.58%	873'376.51	0.08	a)
FR001400AO71	1.6250 % ACACB 1 5/8 05/31/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.52%	87'208.84	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR001400B9U1	2.3750 % CMCICB 2 3/8 02/08/28	100	0	0	100 EUR	97.03%	92'458.27	0.01	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	620	310	0	930 EUR	93.78%	831'034.47	0.08	a)
FR001400CM22	2.3750 % CFF 2 3/8 03/15/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.96%	91'442.50	0.01	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	100	170	0	270 EUR	89.40%	230'012.14	0.02	a)
FR001400CVE3	2.7500 % CADES 2 3/4 11/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.47%	93'829.47	0.01	a)
FR001400DAO4	5.3750 % ORANOF 5 3/8 05/15/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.05%	99'148.47	0.01	a)
FR001400DGZ7	3.1250 % BPCECB 3 1/8 01/24/28	100	0	0	100 EUR	99.70%	95'005.33	0.01	a)
FR001400DHZ5	3.0000 % SOCSFH 3 10/28/25	100	0	0	100 EUR	99.38%	94'699.46	0.01	a)
FR001400DZI3	2.8750 % CADES 2 7/8 05/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.60%	94'905.28	0.01	a)
FR001400EZL5	3.2500 % CMARK 3 1/4 01/10/31	100	0	0	100 EUR	100.79%	96'037.30	0.01	a)
FR001400F5R1	3.1250 % BPCECB 3 1/8 07/20/27	0	100	0	100 EUR	99.74%	95'039.64	0.01	a)
FR001400F5U5	3.0000 % CADES 3 05/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.09%	95'374.10	0.01	a)
FR001400F6X7	3.5000 % SOGRPR 3 1/2 05/25/43 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.59%	93'947.63	0.01	a)
FR001400FD12	3.0000 % LBPSFH 3 01/31/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.48%	94'789.03	0.01	a)
FR001400FDB0	4.2500 % EDF 4 1/4 01/25/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.06%	98'200.35	0.01	a)
FR001400FIG8	3.0000 % BNPPCB 3 01/31/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.65%	94'958.64	0.01	a)
FR001400FIM6	3.0500 % IDFMOB 3.05 02/03/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.97%	94'304.01	0.01	a)
FR001400FKA7	2.8750 % BPIFRA 2 7/8 11/25/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.86%	94'197.29	0.01	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	460	30	430 EUR	93.73%	384'061.46	0.04	a)
FR001400FWP0	3.0000 % BPCECB 3 10/17/29	0	100	0	100 EUR	99.26%	94'587.02	0.01	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	970	0	970 EUR	99.08%	915'774.86	0.08	a)
FR001400G6E6	3.1250 % CADES 3 1/8 03/01/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.12%	96'357.47	0.01	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	0	740	0	740 EUR	101.23%	713'799.79	0.07	a)
FR001400HCM5	3.2500 % CMCICB 3 1/4 04/20/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.43%	95'697.12	0.01	a)
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29	0	660	0	660 EUR	100.08%	629'418.73	0.06	a)
FR001400IUM5	3.3750 % CRH 3 3/8 06/28/32	0	100	0	100 EUR	101.53%	96'743.39	0.01	a)
FR001400IVT8	3.0000 % CADES 3 11/25/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.33%	95'600.88	0.01	a)
FR001400IWZ3	3.3750 % SAGES3 3 3/8 06/29/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.95%	96'195.48	0.01	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33	0	310	0	310 EUR	105.15%	310'618.45	0.03	a)
FR001400L933	3.6250 % CFF 3 5/8 01/16/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.29%	97'465.68	0.01	a)
FR001400NEF3	3.0000 % FRTR 3 06/25/49	0	100	0	100 EUR	95.47%	90'972.73	0.01	a)
FR0124665995	0.1250 % UNEDIC 0 1/8 11/25/24 TNMT	200	0	0	200 EUR	97.25%	185'343.44	0.02	a)
GR0114032577	0.0000 % GGB 0 02/12/26	0	90	0	90 EUR	94.75%	81'252.84	0.01	a)
GR0114033583	3.8750 % GGB 3 7/8 06/15/28	0	60	0	60 EUR	103.59%	59'223.80	0.01	a)
GR0118017657	3.3750 % GGB 3 3/8 02/15/25	0	40	0	40 EUR	100.23%	38'204.14	0.00	a)
GR0118019679	1.8750 % GGB 1 7/8 07/23/26	0	50	0	50 EUR	97.98%	46'683.66	0.00	a)
GR0118020685	2.0000 % GGB 2 04/22/27	0	70	0	70 EUR	97.87%	65'277.75	0.01	a)
GR0124034688	3.7500 % GGB 3 3/4 01/30/28	0	120	0	120 EUR	103.04%	117'822.12	0.01	a)
GR0124035693	3.8750 % GGB 3 7/8 03/12/29	0	80	0	80 EUR	104.17%	79'407.20	0.01	a)
GR0124036709	1.5000 % GGB 1 1/2 06/18/30	0	110	0	110 EUR	90.84%	95'212.77	0.01	a)
GR0124037715	0.7500 % GGB 0 3/4 06/18/31	0	120	0	120 EUR	84.32%	96'413.12	0.01	a)
GR0124038721	1.7500 % GGB 1 3/4 06/18/32	0	70	0	70 EUR	89.14%	59'456.02	0.01	a)
GR0124039737	4.2500 % GGB 4 1/4 06/15/33	0	90	0	90 EUR	107.08%	91'832.99	0.01	a)
GR0124040743	3.3750 % GGB 3 3/8 06/15/34	0	80	0	80 EUR	99.28%	75'684.86	0.01	a)
GR0128015725	3.9000 % GGB 3.9 01/30/33	0	140	0	140 EUR	104.22%	139'031.97	0.01	a)
GR0128016731	1.8750 % GGB 1 7/8 02/04/35	0	90	0	90 EUR	84.99%	72'886.15	0.01	a)
GR0128017747	4.3750 % GGB 4 3/8 07/18/38	0	70	0	70 EUR	107.11%	71'441.00	0.01	a)
GR0133011248	4.0000 % GGB 4 01/30/37	0	110	0	110 EUR	103.87%	108'872.55	0.01	a)
GR0138015814	4.2000 % GGB 4.2 01/30/42	0	110	0	110 EUR	104.96%	110'017.15	0.01	a)
GR0138017836	1.8750 % GGB 1 7/8 01/24/52	0	70	0	70 EUR	68.25%	45'526.67	0.00	a)
HK0000659794	0.0000 % CHINA 0 11/25/25	100	0	0	100 EUR	93.86%	89'437.63	0.01	a)
IE000GLVBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	0	80	0	80 EUR	100.39%	76'528.73	0.01	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	197	20	0	217 EUR	101.98%	210'876.06	0.02	a)
IE00B6X95T99	3.4000 % IRISH 3.4 03/18/24	115	0	115	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDPR44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	130	40	0	170 EUR	93.28%	151'107.67	0.01	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	120	0	0	120 EUR	88.56%	101'268.25	0.01	a)
IE00BFZRRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	115	20	0	135 EUR	91.92%	118'243.92	0.01	a)
IE00BH35QB95	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	170	30	0	200 EUR	92.68%	176'616.93	0.02	a)
IE00BH35QB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	140	50	0	190 EUR	72.46%	131'178.21	0.01	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	155	40	0	195 EUR	98.66%	183'320.52	0.02	a)
IE00BKFCV345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	80	0	0	80 EUR	77.13%	58'795.19	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IE00BKFCV568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	140	20	0	160 EUR	92.45%	140'953.56	0.01	a)
IE00BKFCV899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	140	20	0	160 EUR	85.39%	130'182.17	0.01	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	100	100	0	100 EUR	82.23%	78'353.69	0.01	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	170	20	0	190 EUR	81.96%	148'394.05	0.01	a)
IE00BMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	60	0	0	60 EUR	67.73%	38'721.56	0.00	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	170	50	0	220 EUR	84.19%	176'495.35	0.02	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	180	50	0	230 EUR	96.17%	210'762.65	0.02	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	110	50	0	160 EUR	86.65%	132'100.13	0.01	a)
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	210	20	0	230 EUR	110.18%	241'465.22	0.02	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	460	100	0	560 EUR	111.25%	593'651.68	0.05	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	515	120	30	605 EUR	109.73%	632'587.35	0.06	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	510	140	0	650 EUR	115.87%	717'693.66	0.07	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	410	140	0	550 EUR	115.40%	604'789.84	0.06	a)
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	410	150	0	560 EUR	109.89%	586'394.52	0.05	a)
IT0003621460	5.1250 % ITALY 5 1/8 07/31/24 DMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	500	180	40	640 EUR	100.31%	611'729.79	0.06	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	421	110	0	531 EUR	109.41%	553'588.83	0.05	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	410	80	30	460 EUR	101.37%	444'348.96	0.04	a)
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	385	110	0	495 EUR	109.42%	516'128.14	0.05	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	390	100	0	490 EUR	102.26%	477'451.08	0.04	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	440	120	0	560 EUR	106.05%	565'903.72	0.05	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	285	110	0	395 EUR	106.61%	401'268.24	0.04	a)
IT0004953417	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/24 11Y	510	0	510	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005001547	3.7500 % BTPS 3 3/4 09/01/24 10Y	290	50	340	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	463	90	0	553 EUR	100.55%	529'832.17	0.05	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24 10Y	390	40	430	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	250	100	0	350 EUR	86.14%	287'298.15	0.03	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	341	60	0	401 EUR	97.65%	373'115.28	0.03	a)
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	410	70	0	480 EUR	86.67%	396'433.03	0.04	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	310	120	0	430 EUR	97.80%	400'733.77	0.04	a)
IT0005151854	2.1250 % MONTE 2 1/8 11/26/25	100	0	0	100 EUR	97.11%	92'530.69	0.01	a)
IT0005156044	1.3750 % ISPIM 1 3/8 12/18/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.28%	91'742.66	0.01	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	320	50	0	370 EUR	78.26%	275'904.71	0.03	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	395	50	0	445 EUR	96.43%	408'895.12	0.04	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	260	100	0	360 EUR	83.11%	285'085.17	0.03	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	335	90	0	425 EUR	94.90%	384'309.54	0.04	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	160	60	0	220 EUR	72.65%	152'293.06	0.01	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	345	50	0	395 EUR	89.97%	338'652.18	0.03	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	310	90	0	400 EUR	96.91%	369'387.15	0.03	a)
IT0005246340	1.8500 % BTPS 1.85 05/15/24 7Y	265	0	265	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	320	70	0	390 EUR	88.57%	329'132.97	0.03	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	325	70	0	395 EUR	96.26%	362'327.04	0.03	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24 7Y	310	30	340	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005283491	1.1250 % ISPIM 1 1/8 10/04/27	100	0	0	100 EUR	92.52%	88'162.68	0.01	a)
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	260	70	0	330 EUR	87.67%	275'685.93	0.03	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	420	130	40	510 EUR	95.52%	464'213.62	0.04	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	260	30	0	290 EUR	97.69%	269'961.10	0.02	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	390	60	0	450 EUR	97.96%	420'062.92	0.04	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	320	50	0	370 EUR	98.68%	347'902.39	0.03	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	240	40	0	280 EUR	95.12%	253'797.82	0.02	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	250	60	0	310 EUR	93.82%	277'144.42	0.03	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	410	50	0	460 EUR	98.25%	430'646.88	0.04	a)
IT0005365231	0.5000 % ISPIM 0 1/2 03/05/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005366288	1.0000 % CARPP 1 03/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.93%	88'552.41	0.01	a)
IT0005366460	2.1250 % CDEP 2 1/8 03/21/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.05%	92'472.57	0.01	a)
IT0005367492	1.7500 % BTPS 1 3/4 07/01/24 5Y	240	0	240	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	270	80	0	350 EUR	97.43%	324'948.00	0.03	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	240	70	40	270 EUR	87.70%	225'622.96	0.02	a)
IT0005378036	0.5000 % BACRED 0 1/2 10/01/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.80%	88'425.67	0.01	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	390	100	0	490 EUR	88.72%	414'254.42	0.04	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	310	40	0	350 EUR	97.15%	323'990.83	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	350	70	0	420 EUR	93.58%	374'505.47	0.03	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	260	80	0	340 EUR	72.31%	234'263.71	0.02	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	220	70	0	290 EUR	76.32%	210'897.01	0.02	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	315	40	0	355 EUR	85.68%	289'829.44	0.03	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	280	30	0	310 EUR	97.98%	289'432.80	0.03	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	390	90	0	480 EUR	88.98%	406'980.30	0.04	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	350	130	60	420 EUR	92.48%	370'123.16	0.03	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	310	70	0	380 EUR	94.84%	343'400.68	0.03	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	260	80	0	340 EUR	71.40%	231'305.77	0.02	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	430	110	70	470 EUR	83.79%	375'248.91	0.03	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	230	110	0	340 EUR	60.79%	196'950.89	0.02	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	290	70	0	360 EUR	69.47%	238'311.94	0.02	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	330	40	0	370 EUR	88.77%	312'987.70	0.03	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	350	90	0	440 EUR	81.05%	339'825.66	0.03	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	330	40	0	370 EUR	93.47%	329'530.13	0.03	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	280	0	0	280 EUR	62.94%	167'920.54	0.02	a)
IT0005439275	0.0000 % BTPS 0 04/15/24 3Y	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	100	0	0	100 EUR	60.23%	57'390.26	0.01	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	240	90	0	330 EUR	88.90%	279'544.25	0.03	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	350	90	0	440 EUR	82.48%	345'812.81	0.03	a)
IT0005452989	0.0000 % BTPS 0 08/15/24 3Y	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454050	0.0000 % BTPS 0 01/30/24 3Y	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	300	90	0	390 EUR	92.54%	343'897.61	0.03	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	330	110	0	440 EUR	81.24%	340'626.46	0.03	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	260	100	0	360 EUR	87.04%	298'587.15	0.03	a)
IT0005474330	0.0000 % BTPS 0 12/15/24 3Y	240	50	0	290 EUR	97.33%	268'952.48	0.02	a)
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	190	0	0	190 EUR	66.19%	119'833.76	0.01	a)
IT0005481046	0.3750 % CARPP 0 3/8 01/20/32	100	0	0	100 EUR	78.62%	74'910.93	0.01	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	220	50	0	270 EUR	93.83%	241'394.14	0.02	a)
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	220	70	0	290 EUR	96.90%	267'761.47	0.02	a)
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	310	90	0	400 EUR	91.45%	348'545.68	0.03	a)
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	260	90	0	350 EUR	97.29%	324'471.08	0.03	a)
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	120	100	0	220 EUR	91.15%	191'079.61	0.02	a)
IT0005499311	1.7500 % BTPS 1 3/4 05/30/24 2Y	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	260	100	0	360 EUR	97.97%	336'067.48	0.03	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	180	50	0	230 EUR	101.18%	221'751.49	0.02	a)
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	150	200	0	350 EUR	100.28%	334'436.34	0.03	a)
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	170	250	0	420 EUR	105.36%	421'666.33	0.04	a)
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	200	230	0	430 EUR	102.23%	418'889.34	0.04	a)
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	160	220	0	380 EUR	100.52%	363'967.72	0.03	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	120	70	0	190 EUR	102.32%	185'239.10	0.02	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	280	0	280 EUR	102.62%	273'787.03	0.03	a)
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	0	280	0	280 EUR	99.83%	266'348.44	0.02	a)
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	0	400	70	330 EUR	101.03%	317'680.93	0.03	a)
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	200	0	200 EUR	103.00%	196'292.07	0.02	a)
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	0	310	0	310 EUR	101.27%	299'148.30	0.03	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	0	380	0	380 EUR	104.66%	378'958.48	0.03	a)
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	0	330	0	330 EUR	102.06%	320'935.51	0.03	a)
IT0005549362	3.3750 % UCIGIM 3 3/8 01/31/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.89%	95'184.47	0.01	a)
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	0	380	0	380 EUR	101.44%	367'291.76	0.03	a)
IT0005557084	3.6000 % BTPS 3.6 09/29/25 2Y	0	250	0	250 EUR	100.28%	238'892.63	0.02	a)
IT0005560948	4.2000 % BTPS 4.2 03/01/34 10Y	0	330	0	330 EUR	103.26%	324'690.06	0.03	a)
IT0005561888	4.0000 % BTPS 4 11/15/30 7Y	0	300	0	300 EUR	102.90%	294'140.81	0.03	a)
IT0005562142	3.8750 % BAMIIM 3 7/8 09/18/26	0	100	0	100 EUR	100.58%	95'842.92	0.01	a)
IT0005566408	4.1000 % BTPS 4.1 02/01/29 5Y	0	230	0	230 EUR	103.44%	226'698.01	0.02	a)
IT0005568123	4.7500 % CDEP 4 3/4 10/18/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.53%	99'600.14	0.01	a)
LU0905090048	2.2500 % LGB 2 1/4 03/19/28	35	0	0	35 EUR	97.70%	32'583.18	0.00	a)
LU2076841712	0.0000 % LGB 0 11/13/26	50	0	0	50 EUR	92.53%	44'085.63	0.00	a)
LU2161837203	0.0000 % LGB 0 04/28/25	20	0	0	20 EUR	96.20%	18'333.86	0.00	a)
LU2162831981	0.0000 % LGB 0 04/28/30	50	0	0	50 EUR	84.20%	40'116.39	0.00	a)
LU2228213398	0.0000 % LGB 0 09/14/32	50	0	0	50 EUR	78.93%	37'606.02	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
LU2475494477	1.7500 % LGB 1 3/4 05/25/42	20	0	0	20 EUR	81.99%	15'624.62	0.00	a)
LU2591860569	3.0000 % LGB 3 03/02/33	0	20	0	20 EUR	101.21%	19'287.69	0.00	a)
LU2591861021	3.2500 % LGB 3 1/4 03/02/43	0	30	0	30 EUR	102.45%	29'286.58	0.00	a)
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	303	70	0	373 EUR	112.96%	401'495.75	0.04	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	225	50	0	275 EUR	110.18%	288'729.38	0.03	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	320	70	0	390 EUR	113.11%	420'344.49	0.04	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	257	60	0	317 EUR	98.98%	298'979.96	0.03	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	339	70	0	409 EUR	99.74%	388'700.42	0.04	a)
NL0010733424	2.0000 % NETHER 2 07/15/24	290	0	290	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	347	20	0	367 EUR	96.17%	336'324.87	0.03	a)
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	330	40	0	370 EUR	94.75%	334'039.46	0.03	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	268	70	0	338 EUR	93.89%	302'386.16	0.03	a)
NL0012650469	0.0000 % NETHER 0 01/15/24	240	0	240	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	270	120	0	390 EUR	92.32%	343'091.19	0.03	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	190	40	0	230 EUR	88.36%	193'661.35	0.02	a)
NL0013400401	0.2500 % NGRNV 0 1/4 02/27/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	260	40	0	300 EUR	70.84%	202'498.20	0.02	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	240	50	0	290 EUR	84.87%	234'532.04	0.02	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	250	30	0	280 EUR	82.66%	220'553.62	0.02	a)
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	130	70	0	200 EUR	68.05%	129'681.71	0.01	a)
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	230	40	0	270 EUR	88.15%	226'788.44	0.02	a)
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	130	160	0	290 EUR	94.66%	261'585.35	0.02	a)
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	230	40	0	270 EUR	84.11%	216'386.67	0.02	a)
NL0015000WP1	1.8750 % NGRNV 1 7/8 05/17/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.08%	86'792.43	0.01	a)
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	80	90	0	170 EUR	85.09%	137'839.06	0.01	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	0	230	0	230 EUR	98.49%	215'858.20	0.02	a)
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	0	160	0	160 EUR	99.26%	151'331.60	0.01	a)
NL0015001RG8	3.2500 % NETHER 3 1/4 01/15/44	0	110	0	110 EUR	106.72%	111'855.64	0.01	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	250	90	0	340 EUR	92.59%	299'957.21	0.03	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	240	100	0	340 EUR	48.01%	155'546.21	0.01	a)
PTOTE50E0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37	155	40	0	195 EUR	108.88%	202'304.96	0.02	a)
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45	95	20	0	115 EUR	109.03%	119'474.61	0.01	a)
PTOTECOEO0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	60	40	0	100 EUR	55.58%	52'963.16	0.00	a)
PTOTEKOE0011	2.8750 % PGB 2 7/8 10/15/25	230	50	0	280 EUR	99.90%	266'535.20	0.02	a)
PTOTELOE0028	0.4750 % PGB 0.475 10/18/30	270	0	0	270 EUR	86.53%	222'630.82	0.02	a)
PTOTEMOE0035	0.7000 % PGB 0.7 10/15/27	80	60	0	140 EUR	93.47%	124'697.75	0.01	a)
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	110	0	0	110 EUR	78.31%	82'085.47	0.01	a)
PTOTEOOE0033	0.3000 % PGB 0.3 10/17/31	50	110	0	160 EUR	82.96%	126'486.50	0.01	a)
PTOTEPOE0032	1.1500 % PGB 1.15 04/11/42	0	70	0	70 EUR	69.51%	46'363.11	0.00	a)
PTOTEQOE0015	5.6500 % PGB 5.65 02/15/24	110	0	110	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTEROE0014	3.8750 % PGB 3 7/8 02/15/30	95	60	0	155 EUR	106.38%	157'117.03	0.01	a)
PTOTESOE0021	2.8750 % PGB 2 7/8 10/20/34	0	40	0	40 EUR	97.89%	37'309.20	0.00	a)
PTOTETOE0012	2.8750 % PGB 2 7/8 07/21/26	215	0	0	215 EUR	100.42%	205'726.28	0.02	a)
PTOTEUOE0019	4.1250 % PGB 4 1/8 04/14/27	165	30	0	195 EUR	104.34%	193'882.09	0.02	a)
PTOTEVOE0018	2.1250 % PGB 2 1/8 10/17/28	300	0	0	300 EUR	97.93%	279'936.17	0.03	a)
PTOTEWOE0017	2.2500 % PGB 2 1/4 04/18/34 15Y	205	0	0	205 EUR	93.19%	182'028.60	0.02	a)
PTOTEXOEO024	1.9500 % PGB 1.95 06/15/29	210	40	0	250 EUR	96.49%	229'859.29	0.02	a)
PTOTEYOE0031	1.6500 % PGB 1.65 07/16/32	0	140	0	140 EUR	90.80%	121'131.87	0.01	a)
PTOTEZOE0014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38	0	80	0	80 EUR	101.83%	77'624.17	0.01	a)
RU000A102CK5	1.1250 % RUSSIA 1 1/8 11/20/27	100	0	0	100 EUR	0.00%	0.00	0.00	c)
RU000A1034K8	2.6500 % RUSSIA 2.65 05/27/36	100	0	0	100 EUR	0.00%	0.00	0.00	c)
SI0002102984	4.6250 % SLOREP 4 5/8 09/09/24 RS66	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SI0002103164	5.1250 % SLOREP 5 1/8 03/30/26 RS70	40	0	0	40 EUR	103.72%	39'533.61	0.00	a)
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	40	0	0	40 EUR	83.33%	31'762.27	0.00	a)
SI0002103545	2.1250 % SLOREP 2 1/8 07/28/25 RS75	30	0	0	30 EUR	98.22%	28'077.95	0.00	a)
SI0002103552	3.1250 % SLOREP 3 1/8 08/07/45 RS76	50	0	0	50 EUR	94.97%	45'246.24	0.00	a)
SI0002103602	2.2500 % SLOREP 2 1/4 03/03/32 RS77	62	0	0	62 EUR	94.14%	55'619.12	0.01	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	55	0	0	55 EUR	79.28%	41'550.58	0.00	a)
SI0002103685	1.2500 % SLOREP 1 1/4 03/22/27 RS79	45	0	0	45 EUR	94.70%	40'608.84	0.00	a)
SI0002103776	1.0000 % SLOREP 1 03/06/28 RS80	50	0	0	50 EUR	92.58%	44'109.45	0.00	a)
SI0002103842	1.1875 % SLOREP 1.1875 03/14/29 RS81	60	0	0	60 EUR	91.94%	52'564.86	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SI0002103966	0.2750 % SLOREP 0.275 01/14/30 RS82	0	40	0	40 EUR	85.48%	32'579.46	0.00	a)
SI0002104048	0.4875 % SLOREP 0.4875 10/20/50 RS85	40	0	0	40 EUR	49.39%	18'823.26	0.00	a)
SI0002104105	0.0000 % SLOREP 0 02/12/31 RS86	60	0	0	60 EUR	80.99%	46'303.84	0.00	a)
SI0002104303	3.6250 % SLOREP 3 5/8 03/11/33 RS91	0	30	0	30 EUR	103.44%	29'569.88	0.00	a)
SK4000017059	1.0000 % SLOVGB 1 10/09/30 237	50	0	0	50 EUR	86.13%	41'034.97	0.00	a)
SK4000017158	0.2500 % SLOVGB 0 1/4 05/14/25 238	40	0	0	40 EUR	96.14%	36'645.61	0.00	a)
SK4000017166	1.0000 % SLOVGB 1 05/14/32 239	50	0	0	50 EUR	82.64%	39'370.76	0.00	a)
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	70	0	0	70 EUR	66.94%	44'646.87	0.00	a)
SK4000021986	4.0000 % SLOVGB 4 10/19/32 244	20	20	0	40 EUR	103.02%	39'264.89	0.00	a)
SK4000022539	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 02/23/35 245	0	50	0	50 EUR	99.31%	47'316.38	0.00	a)
SK4000022547	4.0000 % SLOVGB 4 02/23/43 246	0	40	0	40 EUR	100.51%	38'310.87	0.00	a)
SK4000023230	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 06/08/33 247	0	40	0	40 EUR	100.15%	38'172.51	0.00	a)
SK4120007543	4.3500 % SLOVGB 4.35 10/14/25 216	70	0	0	70 EUR	101.26%	67'541.61	0.01	a)
SK4120008871	3.3750 % SLOVGB 3 3/8 11/15/24 223	80	0	0	80 EUR	99.79%	76'069.06	0.01	a)
SK4120008954	3.8750 % SLOVGB 3 7/8 02/08/33 224	20	0	0	20 EUR	102.26%	19'489.13	0.00	a)
SK4120009762	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 01/16/29 227	50	0	0	50 EUR	101.94%	48'566.08	0.00	a)
SK4120010430	1.3750 % SLOVGB 1 3/8 01/21/27 228	58	0	0	58 EUR	94.60%	52'282.25	0.00	a)
SK4120011420	1.6250 % SLOVGB 1 5/8 01/21/31 229	65	0	0	65 EUR	89.02%	55'139.17	0.01	a)
SK4120012220	0.6250 % SLOVGB 0 5/8 05/22/26 231	30	0	0	30 EUR	94.31%	26'960.50	0.00	a)
SK4120012691	1.8750 % SLOVGB 1 7/8 03/09/37 232	45	0	0	45 EUR	80.37%	34'460.31	0.00	a)
SK4120013400	2.0000 % SLOVGB 2 10/17/47 233	90	0	0	90 EUR	70.12%	60'130.28	0.01	a)
SK4120014150	1.0000 % SLOVGB 1 06/12/28 234	40	0	0	40 EUR	91.32%	34'808.07	0.00	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	50	0	0	50 EUR	85.83%	40'891.56	0.00	a)
XS0177618039	5.0000 % RESFER 5 10/10/33 EMTN	80	0	0	80 EUR	113.56%	86'567.55	0.01	a)
XS0219724878	4.0000 % EIB 4 10/15/37 EARN	100	0	0	100 EUR	110.58%	105'369.84	0.01	a)
XS0290050524	4.1250 % EIB 4 1/8 04/15/24 EARN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0427291751	4.5000 % EIB 4 1/2 10/15/25 EARN	150	0	0	150 EUR	102.06%	145'874.06	0.01	a)
XS0479333311	5.2500 % POLAND 5 1/4 01/20/25 EMTN	30	0	0	30 EUR	101.23%	28'939.26	0.00	a)
XS0505157965	4.0000 % EIB 4 04/15/30 EARN	105	0	0	105 EUR	106.62%	106'675.25	0.01	a)
XS0524471355	3.7500 % DBHNGR 3 3/4 07/09/25 EMTN	30	0	0	30 EUR	100.54%	28'742.01	0.00	a)
XS0542825160	3.3750 % ASFING 3 3/8 09/22/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	100.03%	47'656.56	0.00	a)
XS0611783928	4.2500 % RESFER 4 1/4 10/07/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	102.43%	97'605.75	0.01	a)
XS0691970601	3.5000 % OBND 3 1/2 10/19/26 30	40	0	0	40 EUR	100.99%	38'493.06	0.00	a)
XS0752034206	3.6250 % EIB 3 5/8 03/14/42 EMTN	25	30	0	55 EUR	106.22%	55'669.45	0.01	a)
XS0755873253	3.5000 % EIB 3 1/2 04/15/27 EARN	50	0	0	50 EUR	101.89%	48'542.26	0.00	a)
XS0782697071	3.3750 % OBND 3 3/8 05/18/32 EMTN	40	0	0	40 EUR	103.03%	39'269.09	0.00	a)
XS0790003023	2.7500 % ASFING 2 3/4 06/11/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.82%	94'163.94	0.01	a)
XS0807336077	2.7500 % EIB 2 3/4 09/15/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.39%	94'703.27	0.01	a)
XS0841073793	3.3750 % POLAND 3 3/8 07/09/24 EMTN	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0878008225	2.6250 % EIB 2 5/8 03/15/35 1981	50	0	0	50 EUR	96.73%	46'088.11	0.00	a)
XS0884635524	2.7500 % EIB 2 3/4 03/15/40 EMTN	50	0	0	50 EUR	95.71%	45'601.19	0.00	a)
XS0936339208	2.2500 % AGFRNC 2 1/4 05/27/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.27%	93'643.66	0.01	a)
XS0975634204	3.0000 % EIB 3 10/14/33 EARN	60	60	0	120 EUR	100.85%	115'320.23	0.01	a)
XS0984087204	3.0000 % OBND 3 10/24/33 EMTN	30	0	0	30 EUR	100.23%	28'651.39	0.00	a)
XS0985666436	3.1250 % RESFER 3 1/8 10/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.96%	95'253.08	0.01	a)
XS1074208270	2.5000 % ENBW 2 1/2 06/04/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.19%	93'566.48	0.01	a)
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	0	100	0	100 EUR	97.77%	93'159.60	0.01	a)
XS1107247725	1.7500 % EIB 1 3/4 09/15/45 EMTN	30	50	0	80 EUR	78.82%	60'088.06	0.01	a)
XS1107718279	1.2500 % EIB 1 1/4 11/13/26 EMTN	40	0	0	40 EUR	96.01%	36'596.06	0.00	a)
XS1132790442	1.0000 % NDAFH 1 11/05/24 FI43	100	0	0	100 EUR	98.16%	93'537.89	0.01	a)
XS1138366445	1.0000 % OBND 1 11/18/24	40	0	0	40 EUR	98.05%	37'372.47	0.00	a)
XS1183208328	1.0000 % EIB 1 03/14/31 EMTN	50	0	0	50 EUR	88.54%	42'182.24	0.00	a)
XS1191309720	0.8750 % NAB 0 7/8 02/19/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.93%	88'547.64	0.01	a)
XS1192872866	0.6250 % RENTEN 0 5/8 02/20/30 EMTN	50	0	0	50 EUR	88.05%	41'951.17	0.00	a)
XS1198103456	3.0000 % MEX 3 03/06/45 GMTN	100	0	0	100 EUR	75.64%	72'076.10	0.01	a)
XS1207449684	0.1250 % EIB 0 1/8 04/15/25 EARN	50	0	0	50 EUR	96.53%	45'988.53	0.00	a)
XS1209947271	0.8750 % POLAND 0 7/8 05/10/27 EMTN	40	0	0	40 EUR	93.78%	35'743.42	0.00	a)
XS1224445202	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 04/29/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.47%	82'394.87	0.01	a)
XS1227748214	0.2500 % BNG 0 1/4 05/07/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.39%	183'700.67	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1247736793	0.8750 % EIB 0 7/8 09/13/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1288467605	1.5000 % POLAND 1 1/2 09/09/25 EMTN	35	0	0	35 EUR	97.10%	32'382.41	0.00	a)
XS1298431799	1.5000 % ABNANV 1 1/2 09/30/30	100	100	0	200 EUR	90.96%	173'342.83	0.02	a)
XS1309529680	1.3750 % BNG 1 3/8 10/21/30 EMTN	45	0	0	45 EUR	90.52%	38'813.89	0.00	a)
XS1310032187	1.2500 % LITHUN 1 1/4 10/22/25 EMTN	45	0	0	45 EUR	96.61%	41'427.41	0.00	a)
XS1310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	22	0	0	22 EUR	86.84%	18'205.48	0.00	a)
XS1312891549	2.7500 % ROMANI 2 3/4 10/29/25 REGS	120	0	0	120 EUR	98.01%	112'065.95	0.01	a)
XS1313004928	3.8750 % ROMANI 3 7/8 10/29/35 REGS	30	0	0	30 EUR	84.53%	24'162.74	0.00	a)
XS1314321941	4.2500 % CYPRUS 4 1/4 11/04/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	102.15%	48'669.47	0.00	a)
XS1346201889	2.3750 % POLAND 2 3/8 01/18/36 EMTN	40	0	0	40 EUR	86.81%	33'088.68	0.00	a)
XS1361554584	1.1250 % EIB 1 1/8 09/15/36 EMTN	50	50	0	100 EUR	80.48%	76'689.01	0.01	a)
XS1369323149	3.3750 % MEX 3 3/8 02/23/31	100	0	0	100 EUR	95.74%	91'226.20	0.01	a)
XS1379610675	0.3750 % RENTEN 0 3/8 03/16/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.64%	90'176.12	0.01	a)
XS1382696398	3.0000 % BGARIA 3 03/21/28 12YR	100	0	0	100 EUR	98.81%	94'158.22	0.01	a)
XS1392927072	0.5000 % FINNVE 0 1/2 04/13/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.66%	90'203.75	0.01	a)
XS1394055872	0.3750 % EIB 0 3/8 04/14/26 EARN	130	0	0	130 EUR	94.66%	117'254.97	0.01	a)
XS1420357318	2.8750 % ROMANI 2 7/8 05/26/28 REGS	60	0	0	60 EUR	93.61%	53'521.93	0.00	a)
XS1420379551	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 05/27/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.23%	77'399.86	0.01	a)
XS1422953932	1.0000 % EIB 1 04/14/32 EARN	60	0	0	60 EUR	86.95%	49'711.93	0.00	a)
XS1428088626	3.0000 % CROATI 3 03/20/27	100	0	0	100 EUR	99.65%	94'957.69	0.01	a)
XS1432384664	1.0000 % TENN 1 06/13/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.75%	91'242.40	0.01	a)
XS1445725218	0.0500 % BNG 0.05 07/13/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1484645616	0.0000 % KAFKAE 0 01/14/32 REGS	30	0	0	30 EUR	77.32%	22'103.94	0.00	a)
XS1499594916	0.7500 % NEDWBK 0 3/4 10/04/41 EMTN	100	0	0	100 EUR	66.23%	63'108.51	0.01	a)
XS1500338618	0.5000 % EIB 0 1/2 11/13/37 EMTN	50	0	0	50 EUR	71.90%	34'256.16	0.00	a)
XS1501554874	0.3750 % LATVIA 0 3/8 10/07/26 GMTN	100	0	0	100 EUR	93.25%	88'851.61	0.01	a)
XS1501560848	0.1250 % AFDB 0 1/8 10/07/26 GDIF	100	0	0	100 EUR	92.75%	88'382.79	0.01	a)
XS1508566392	1.0000 % POLAND 1 10/25/28 EMTN	40	0	0	40 EUR	91.93%	35'039.43	0.00	a)
XS1511781897	0.6250 % RENTEN 0 5/8 10/31/36 EMTN	70	0	0	70 EUR	75.46%	50'333.21	0.00	a)
XS1511904564	0.8750 % KOMMUN 0 7/8 11/03/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	77.34%	73'697.91	0.01	a)
XS1515222385	0.7500 % EQNR 0 3/4 11/09/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.17%	88'783.00	0.01	a)
XS1515245089	0.0000 % EIB 0 03/15/24 GMTN	90	0	90	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1548458014	1.1250 % ABNANV 1 1/8 01/12/32	100	0	0	100 EUR	86.72%	82'635.00	0.01	a)
XS1548533329	0.6250 % KUNTA 0 5/8 11/26/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.90%	89'478.61	0.01	a)
XS1550143421	0.3750 % SBAB 0 3/8 02/16/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550203183	0.6250 % ERSTBK 0 5/8 01/18/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.72%	88'347.54	0.01	a)
XS1551045039	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 01/18/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.59%	89'180.36	0.01	a)
XS1551294256	1.5000 % ISRAEL 1 1/2 01/18/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.27%	87'919.69	0.01	a)
XS1555331617	0.5000 % EIB 0 1/2 01/15/27 EARN	125	0	0	125 EUR	93.52%	111'393.26	0.01	a)
XS1558472129	1.5000 % SNCF 1 1/2 02/02/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.24%	87'895.87	0.01	a)
XS1559352437	0.6250 % DEXGRP 0 5/8 02/03/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1566992415	0.3750 % EIKBOL 0 3/8 02/16/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1575991358	0.2500 % EIB 0 1/4 10/14/24 EARN	90	0	0	90 EUR	98.04%	84'075.19	0.01	a)
XS1599193403	2.3750 % ROMANI 2 3/8 04/19/27 REGS	40	0	0	40 EUR	94.35%	35'962.20	0.00	a)
XS1606720131	0.8750 % Q 0 7/8 05/04/27	100	0	0	100 EUR	93.27%	88'877.34	0.01	a)
XS1612940558	0.2500 % KFW 0 1/4 06/30/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.15%	91'617.83	0.01	a)
XS1612977717	1.1250 % EIB 1 1/8 04/13/33 EARN	95	0	0	95 EUR	86.11%	77'947.43	0.01	a)
XS1619567677	0.9500 % LITHUN 0.95 05/26/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.49%	88'132.18	0.01	a)
XS1629737625	0.3750 % ONT 0 3/8 06/14/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1632891138	0.6250 % BNG 0 5/8 06/19/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.96%	88'575.27	0.01	a)
XS1637276848	2.7500 % CYPRUS 2 3/4 06/27/24 EMTN	20	0	0	20 EUR	100.01%	19'058.62	0.00	a)
XS1641457277	1.5000 % EIB 1 1/2 11/15/47	35	0	0	35 EUR	73.08%	24'371.52	0.00	a)
XS1647481206	2.1500 % INDON 2.15 07/18/24 REGS	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1648462023	2.2500 % RESFER 2 1/4 12/20/47 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.93%	73'306.27	0.01	a)
XS1669866300	0.3750 % JYKRE 0 3/8 07/01/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1673096829	0.2500 % RENTEN 0 1/4 08/29/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.83%	91'315.77	0.01	a)
XS1696445516	1.7500 % REPHUN 1 3/4 10/10/27	40	0	0	40 EUR	93.15%	35'502.91	0.00	a)
XS1700578724	1.0000 % DEXGRP 1 10/18/27 EMTN	0	50	0	50 EUR	93.09%	44'353.86	0.00	a)
XS1709328899	1.6250 % BGOSK 1 5/8 04/30/28	100	0	0	100 EUR	91.55%	87'235.52	0.01	a)
XS1713475306	2.7500 % CROATI 2 3/4 01/27/30	100	0	0	100 EUR	97.59%	92'994.75	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1721760541	1.5000 % ORSTED 1 1/2 11/26/29	100	0	0	100 EUR	89.00%	84'808.53	0.01	a)
XS1747670922	1.2500 % ABNAV 1 1/4 01/10/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.00%	81'943.21	0.01	a)
XS1748479919	0.5000 % SANUK 0 1/2 01/10/25	100	0	0	100 EUR	97.20%	92'619.31	0.01	a)
XS1751001139	1.7500 % MEX 1 3/4 04/17/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.26%	87'908.26	0.01	a)
XS1751347946	0.5000 % DEXGRP 0 1/2 01/17/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.26%	92'673.63	0.01	a)
XS1752475720	1.0000 % DBHNGR 1 12/17/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	92.37%	44'008.44	0.00	a)
XS1753042743	1.5000 % EIB 1 1/2 10/16/48 EARN	70	0	0	70 EUR	71.94%	47'983.30	0.00	a)
XS1753809141	1.0000 % NIBCAP 1 01/24/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.09%	87'749.12	0.01	a)
XS1756367816	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/24/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.29%	92'708.88	0.01	a)
XS1760129608	0.5000 % SPABOL 0 1/2 01/30/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.15%	92'572.62	0.01	a)
XS1766477522	0.8750 % RABOBK 0 7/8 02/08/28	100	0	0	100 EUR	92.09%	87'753.89	0.01	a)
XS1766612672	1.1250 % POLAND 1 1/8 08/07/26 EMTN	0	40	0	40 EUR	95.64%	36'453.13	0.00	a)
XS1767931477	0.3750 % HESLAN 0 3/8 02/08/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1768074319	3.3750 % ROMANI 3 3/8 02/08/38 REGS	0	50	0	50 EUR	77.52%	36'933.28	0.00	a)
XS1784071042	1.3750 % NDAFH 1 3/8 02/28/33	100	0	0	100 EUR	86.61%	82'533.04	0.01	a)
XS1788694856	1.0000 % DEVOBA 1 03/08/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.22%	87'875.86	0.01	a)
XS1791423178	1.2500 % FINNVE 1 1/4 07/14/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.87%	82'776.03	0.01	a)
XS1791485011	0.8750 % EIB 0 7/8 01/14/28 EARN	120	0	0	120 EUR	92.82%	106'140.54	0.01	a)
XS1793273092	0.8750 % HESLAN 0 7/8 03/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.58%	87'266.97	0.01	a)
XS1799045197	0.3750 % COE 0 3/8 03/27/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.74%	46'091.92	0.00	a)
XS1805257265	0.8750 % INTNED 0 7/8 04/11/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.52%	87'208.84	0.01	a)
XS1805353734	1.4500 % ABNAV 1.45 04/12/38	100	0	0	100 EUR	79.64%	75'886.68	0.01	a)
XS1808478710	0.6250 % ALTA 0 5/8 04/18/25	0	100	0	100 EUR	96.81%	92'251.50	0.01	a)
XS1811812574	1.5000 % RABOBK 1 1/2 04/26/38 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.63%	76'827.18	0.01	a)
XS1824248626	0.8750 % AFDB 0 7/8 05/24/28 GDIF	50	0	0	50 EUR	91.99%	43'827.87	0.00	a)
XS1832967019	0.6250 % TD 0 5/8 06/06/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.34%	91'802.69	0.01	a)
XS1843433639	0.8300 % CHILE 0.83 07/02/31	100	0	0	100 EUR	81.29%	77'458.94	0.01	a)
XS1850111789	0.3750 % EIB 0 3/8 07/16/25 EARN	100	0	0	100 EUR	96.23%	91'696.92	0.01	a)
XS1851226891	0.7500 % KOMMUN 0 3/4 07/05/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.51%	87'202.17	0.01	a)
XS1855473614	0.5000 % SHBASS 0 1/2 07/11/25	100	0	0	100 EUR	96.03%	91'504.44	0.01	a)
XS1856342560	0.6250 % VORHYP 0 5/8 07/17/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.64%	89'223.24	0.01	a)
XS1876471183	0.6250 % RY 0 5/8 09/10/25 GMTN	100	0	0	100 EUR	95.81%	91'294.80	0.01	a)
XS1881014374	0.2000 % EIB 0.2 07/15/24 EARN	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1883942648	2.3750 % CYPRUS 2 3/8 09/25/28 EMTN	70	0	0	70 EUR	97.30%	64'899.55	0.01	a)
XS1885608817	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 03/28/31 EMTN	70	0	0	70 EUR	88.84%	59'260.58	0.01	a)
XS1887498282	1.2500 % REPHUN 1 1/4 10/22/25	40	0	0	40 EUR	95.75%	36'495.43	0.00	a)
XS1894534343	0.7500 % SRBANK 0 3/4 10/17/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.79%	91'277.65	0.01	a)
XS1903442744	2.1250 % ESBIRE 2 1/8 11/05/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.49%	83'368.72	0.01	a)
XS1909057645	3.2500 % LOGICR 3 1/4 11/13/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.83%	90'362.88	0.01	a)
XS1912495691	0.6250 % IBRD 0 5/8 11/22/27 GDIF	0	20	0	20 EUR	92.21%	17'573.46	0.00	a)
XS1934743656	0.6250 % DNBNO 0 5/8 01/14/26	100	0	0	100 EUR	95.02%	90'538.21	0.01	a)
XS1935275237	0.1250 % KUNTA 0 1/8 03/07/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1936100483	1.5000 % ISRAEL 1 1/2 01/16/29 EMTN	0	50	0	50 EUR	87.65%	41'759.16	0.00	a)
XS1936101291	2.5000 % ISRAEL 2 1/2 01/16/49	60	0	0	60 EUR	75.19%	42'987.24	0.00	a)
XS1938387237	0.6250 % EIB 0 5/8 01/22/29 EARN	90	0	0	90 EUR	90.08%	77'253.88	0.01	a)
XS1940071597	0.7500 % BNG 0 3/4 01/24/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.25%	86'001.54	0.01	a)
XS1942629061	0.8750 % RFLBNI 0 7/8 01/30/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.18%	84'980.05	0.01	a)
XS1942756096	0.6250 % COE 0 5/8 01/30/29 EMTN	40	0	0	40 EUR	90.09%	34'337.72	0.00	a)
XS1943561883	1.0000 % SPABOL 1 01/30/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.12%	85'870.99	0.01	a)
XS1946788194	0.5000 % SWEDA 0 1/2 02/05/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.64%	90'181.84	0.01	a)
XS1950839677	0.0500 % EIB 0.05 05/24/24 EARN	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1951084638	0.5000 % SVEGNO 0 1/2 02/12/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.62%	90'159.92	0.01	a)
XS1952576475	0.7500 % INTNED 0 3/4 02/18/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.51%	85'288.78	0.01	a)
XS1953056253	1.8750 % LATVIA 1 7/8 02/19/49 GMTN	100	0	0	100 EUR	69.95%	66'650.38	0.01	a)
XS1957349332	0.5000 % RENTEN 0 1/2 02/28/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.22%	85'017.21	0.01	a)
XS1957516252	0.3750 % DAA 0 3/8 03/01/27 1477	100	0	0	100 EUR	92.04%	87'705.29	0.01	a)
XS1958534528	1.0000 % POLAND 1 03/07/29 EMTN	0	50	0	50 EUR	91.00%	43'355.72	0.00	a)
XS1960361720	2.0000 % POLAND 2 03/08/49 EMTN	50	0	0	50 EUR	68.32%	32'552.40	0.00	a)
XS1968706876	4.6250 % ROMANI 4 5/8 04/03/49 REGS	60	0	0	60 EUR	83.68%	47'840.65	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1978552237	0.1000 % EIB 0.1 10/15/26 EARN	100	0	0	100 EUR	93.01%	88'630.54	0.01	a)
XS1979512578	0.0000 % COE 0 04/10/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	93.76%	44'670.70	0.00	a)
XS1989383788	2.7500 % CYPRUS 2 3/4 05/03/49 EMTN	30	0	0	30 EUR	84.10%	24'042.39	0.00	a)
XS1998930926	0.2500 % IBRD 0 1/4 05/21/29 GDIF	50	0	0	50 EUR	87.63%	41'752.49	0.00	a)
XS1999841445	0.0100 % KFW 0.01 05/05/27 EMTN	50	60	0	110 EUR	91.37%	95'767.26	0.01	a)
XS2001278899	1.7500 % ACEIM 1 3/4 05/23/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.60%	88'237.00	0.01	a)
XS2001737910	1.1250 % TELNO 1 1/8 05/31/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.20%	85'000.06	0.01	a)
XS2002491780	0.8750 % TENN 0 7/8 06/03/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.31%	86'056.80	0.01	a)
XS2002491863	1.5000 % TENN 1 1/2 06/03/39 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.55%	80'563.43	0.01	a)
XS2004366287	0.0500 % NWIDE 0.05 06/03/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2009891479	0.5000 % VATFAL 0 1/2 06/24/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.21%	88'822.07	0.01	a)
XS2013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	30	0	0	30 EUR	65.55%	18'737.88	0.00	a)
XS2014288315	0.0500 % RY 0.05 06/19/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.69%	88'322.76	0.01	a)
XS2015227494	0.1250 % EIB 0 1/8 06/20/29 EARN	100	0	0	100 EUR	86.89%	82'796.99	0.01	a)
XS2016138765	0.5000 % IBRD 0 1/2 06/21/35 GDIF	70	0	0	70 EUR	76.30%	50'895.50	0.00	a)
XS2019816979	0.8050 % BNG 0.805 06/28/49 EMTN	100	0	0	100 EUR	57.17%	54'474.44	0.00	a)
XS2023679843	0.0500 % KUNTA 0.05 09/06/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.88%	81'832.67	0.01	a)
XS2024543055	2.0000 % KSA 2 07/09/39 REGS	100	0	0	100 EUR	75.08%	71'545.34	0.01	a)
XS2026150313	1.0000 % AEMSPA 1 07/16/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.13%	83'025.68	0.01	a)
XS2027596530	2.1240 % ROMANI 2.124 07/16/31 REGS	30	0	0	30 EUR	80.50%	23'012.99	0.00	a)
XS2035564629	1.6250 % ENBW 1 5/8 08/05/2079	100	0	0	100 EUR	90.13%	85'882.43	0.01	a)
XS2054600718	0.1250 % LLOYDS 0 1/8 09/23/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.60%	80'617.75	0.01	a)
XS2055781962	0.0500 % EIB 0.05 10/13/34 EARN	40	0	0	40 EUR	74.00%	28'204.20	0.00	a)
XS2057917366	0.0100 % HYNOC 0.01 10/01/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.82%	87'497.56	0.01	a)
XS2058855441	0.0100 % BAWAG 0.01 10/02/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.80%	79'851.63	0.01	a)
XS2058989489	0.0100 % DANBNK 0.01 01/14/28	100	0	0	100 EUR	88.38%	84'212.97	0.01	a)
XS2060691040	0.3750 % NEGANV 0 3/8 10/03/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.69%	75'931.47	0.01	a)
XS2062986422	0.0000 % OKB 0 10/08/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.52%	88'157.91	0.01	a)
XS2063423318	0.2500 % IBRD 0 1/4 01/10/50 GDIF	50	0	0	50 EUR	49.96%	23'802.07	0.00	a)
XS2066003901	0.0000 % IDAWBG 0 10/19/26	100	0	0	100 EUR	92.35%	87'996.87	0.01	a)
XS2069102163	0.0500 % KBN 0.05 10/24/29	100	0	0	100 EUR	85.26%	81'239.03	0.01	a)
XS2069959398	1.4000 % INDON 1.4 10/30/31	100	0	0	100 EUR	83.98%	80'019.33	0.01	a)
XS2078533218	0.5000 % CHINA 0 1/2 11/12/31	100	0	0	100 EUR	82.30%	78'423.26	0.01	a)
XS2079678400	0.5000 % STEDIN 0 1/2 11/14/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.92%	80'922.67	0.01	a)
XS2101336316	0.3750 % ABNANV 0 3/8 01/14/35	100	100	0	200 EUR	74.80%	142'558.98	0.01	a)
XS2102284622	0.1000 % BNG 0.1 01/15/30	100	0	0	100 EUR	84.94%	80'936.01	0.01	a)
XS2102495673	0.0500 % EIB 0.05 01/16/30 EARN	100	0	0	100 EUR	85.33%	81'304.77	0.01	a)
XS2102988354	0.0000 % IBRD 0 01/15/27 GMTN	50	0	0	50 EUR	92.02%	43'840.73	0.00	a)
XS2105097393	1.2500 % CYPRUS 1 1/4 01/21/40 EMTN	30	0	0	30 EUR	71.41%	20'413.91	0.00	a)
XS2110875957	0.0250 % ASIA 0.025 01/31/30	80	0	0	80 EUR	84.74%	64'596.35	0.01	a)
XS2114767457	0.0000 % POLAND 0 02/10/25 EMTN	40	0	0	40 EUR	96.53%	36'791.59	0.00	a)
XS2120068403	0.0000 % EIB 0 03/25/25 EARN	50	0	0	50 EUR	96.50%	45'976.15	0.00	a)
XS2122894855	0.0000 % IBRD 0 02/21/30 GDIF	50	0	0	50 EUR	84.52%	40'270.28	0.00	a)
XS2138444661	0.0100 % BNS 0.01 03/18/25	100	0	0	100 EUR	96.22%	91'686.44	0.01	a)
XS2150158405	0.1250 % NEDFIN 0 1/8 04/03/27	100	0	0	100 EUR	91.82%	87'491.85	0.01	a)
XS2152902719	0.7970 % CHGRID 0.797 08/05/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.86%	132'719.98	0.01	a)
XS2160861808	0.0100 % IBRD 0.01 04/24/28 GDIF	50	0	0	50 EUR	88.98%	42'394.26	0.00	a)
XS2166209176	0.0000 % NIB 0 04/30/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.42%	87'109.74	0.01	a)
XS2168038847	0.7500 % LITHUN 0 3/4 05/06/30 EMTN	30	0	0	30 EUR	85.04%	24'309.67	0.00	a)
XS2168048564	0.0000 % EIB 0 06/17/27 EARN	100	0	0	100 EUR	91.09%	86'794.34	0.01	a)
XS2176621253	0.1000 % EUROF 0.1 05/20/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.37%	80'395.72	0.01	a)
XS2178857954	3.6240 % ROMANI 3.624 05/26/30 REGS	100	0	0	100 EUR	91.57%	87'256.48	0.01	a)
XS2181347183	0.1250 % ESTONI 0 1/8 06/10/30	30	0	0	30 EUR	83.03%	23'735.37	0.00	a)
XS2181689659	1.7500 % REPHUN 1 3/4 06/05/35	100	0	0	100 EUR	74.20%	70'705.85	0.01	a)
XS2193666042	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 06/23/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.74%	82'656.92	0.01	a)
XS2194790262	0.0100 % EIB 0.01 11/15/35	50	0	0	50 EUR	71.00%	33'826.88	0.00	a)
XS2197945251	0.0100 % RABOBK 0.01 07/02/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.87%	78'963.54	0.01	a)
XS2199719233	0.1250 % BNG 0 1/8 07/09/35	200	0	0	200 EUR	72.34%	137'865.07	0.01	a)
XS2209794408	0.0000 % KFW 0 09/15/28 EMTN	50	60	0	110 EUR	88.16%	92'401.58	0.01	a)
XS2210006339	0.5000 % LITHUN 0 1/2 07/28/50 EMTN	50	0	0	50 EUR	48.46%	23'088.84	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2225428809	0.0000 % EIB 0 09/09/30 EARN	100	0	0	100 EUR	83.31%	79'383.76	0.01	a)
XS2227906034	0.0500 % KUNTA 0.05 09/10/35 EMTN	100	0	0	100 EUR	71.40%	68'034.92	0.01	a)
XS2233120554	0.0000 % RENTEN 0 09/22/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.30%	86'046.32	0.01	a)
XS2238292010	0.0100 % DNBNO 0.01 10/08/27	100	0	0	100 EUR	89.30%	85'096.30	0.01	a)
XS2251371022	0.0000 % EIB 0 03/28/28 EARN	100	0	0	100 EUR	89.20%	85'001.01	0.01	a)
XS2259191273	0.5000 % REPHUN 0 1/2 11/18/30	40	0	0	40 EUR	78.29%	29'839.35	0.00	a)
XS2259191430	1.5000 % REPHUN 1 1/2 11/17/50	50	0	0	50 EUR	56.23%	26'789.36	0.00	a)
XS2262211076	1.3750 % ROMANI 1 3/8 12/02/29 REGS	50	0	0	50 EUR	82.51%	39'309.30	0.00	a)
XS2270142966	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 12/08/50 EMTN	100	0	0	100 EUR	52.75%	50'259.83	0.00	a)
XS2283340060	0.0000 % EIB 0 01/14/31 EARN	100	40	0	140 EUR	82.64%	110'238.13	0.01	a)
XS2286422071	0.0000 % COE 0 01/20/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.56%	78'666.24	0.01	a)
XS2287879733	0.0100 % EIB 0.01 05/15/41 EMTN	0	60	0	60 EUR	59.21%	33'850.42	0.00	a)
XS2289130226	0.0000 % DEXGRP 0 01/21/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.01%	84'815.20	0.01	a)
XS2291692890	1.2500 % CHILE 1 1/4 01/22/51	100	0	0	100 EUR	54.22%	51'668.20	0.00	a)
XS2291901994	0.0100 % SORBNO 0.01 01/26/28	0	100	0	100 EUR	88.33%	84'165.33	0.01	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	100	0	0	100 EUR	93.14%	88'755.37	0.01	a)
XS2308323661	0.2000 % EIB 0.2 03/17/36 EARN	50	0	0	50 EUR	71.86%	34'237.58	0.00	a)
XS2309428113	1.1250 % CROATI 1 1/8 03/04/33	100	0	0	100 EUR	82.77%	78'868.25	0.01	a)
XS2324321368	0.0500 % OPBANK 0.05 03/25/31	100	0	0	100 EUR	80.59%	76'790.01	0.01	a)
XS2330503694	2.0000 % ROMANI 2 04/14/33 REGS	100	0	0	100 EUR	75.02%	71'481.50	0.01	a)
XS2330514899	2.7500 % ROMANI 2 3/4 04/14/41 REGS	45	0	0	45 EUR	66.19%	28'382.54	0.00	a)
XS2331327564	0.0000 % KFW 0 06/15/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.39%	82'316.74	0.01	a)
XS2333391485	0.7500 % LUCSHI 0 3/4 04/22/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.43%	74'737.50	0.01	a)
XS2334114779	0.3500 % IDAWBG 0.35 04/22/36	80	0	0	80 EUR	73.09%	55'716.23	0.01	a)
XS2334361354	1.2000 % PHILIP 1.2 04/28/33	0	100	0	100 EUR	79.54%	75'792.34	0.01	a)
XS2337335710	0.0100 % CM 0.01 04/30/29	100	0	0	100 EUR	84.81%	80'814.99	0.01	a)
XS2338991941	0.2500 % Q 0 1/4 05/05/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.07%	78'205.04	0.01	a)
XS2339427820	0.8750 % ETISLT 0 7/8 05/17/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.70%	75'947.66	0.01	a)
XS2343538372	0.0000 % EIB 0 09/28/28 EARN	40	50	0	90 EUR	88.05%	75'512.10	0.01	a)
XS2344384768	0.1000 % ONTTFT 0.1 05/19/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.82%	83'681.27	0.01	a)
XS2346124410	0.3750 % HESLAN 0 3/8 06/04/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.11%	78'244.11	0.01	a)
XS2351088955	0.2500 % ONT 0 1/4 06/09/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.56%	77'715.26	0.01	a)
XS2355599353	0.0100 % KHFC 0.01 06/29/26 REGS	100	0	0	100 EUR	92.12%	87'775.81	0.01	a)
XS2364200514	2.8750 % ROMANI 2 7/8 04/13/42 REGS	0	40	0	40 EUR	66.29%	25'265.13	0.00	a)
XS2369244087	0.1000 % CHILE 0.1 01/26/27	100	0	0	100 EUR	90.27%	86'019.64	0.01	a)
XS2386592138	0.0100 % BNS 0.01 09/14/29	150	0	0	150 EUR	83.64%	119'551.61	0.01	a)
XS2387713238	0.4000 % ABNANV 0.4 09/17/41 EMTN	0	100	0	100 EUR	61.32%	58'434.62	0.01	a)
XS2388390507	0.0100 % WSTP 0.01 09/22/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.76%	81'723.09	0.01	a)
XS2388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	50	50	0	100 EUR	81.27%	77'437.97	0.01	a)
XS2388495942	0.0000 % EIB 0 12/22/26 EARN	0	60	0	60 EUR	92.33%	52'786.12	0.00	a)
XS2393518910	0.0100 % RY 0.01 10/05/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.25%	82'187.14	0.01	a)
XS2397077426	0.1250 % CBAAU 0 1/8 10/15/29	100	0	0	100 EUR	84.08%	80'115.58	0.01	a)
XS2400299363	0.7000 % IBRD 0.7 10/22/46	0	40	0	40 EUR	61.27%	23'354.03	0.00	a)
XS2408608219	1.9500 % PERU 1.95 11/17/36	100	0	0	100 EUR	76.05%	72'468.69	0.01	a)
XS2412060092	0.0000 % ICO 0 04/30/25 GMTN	40	0	0	40 EUR	96.01%	36'595.30	0.00	a)
XS2429205540	0.2500 % BAWAG 0 1/4 01/12/32	0	100	0	100 EUR	79.49%	75'741.84	0.01	a)
XS2430951744	0.1250 % BMO 0 1/8 01/26/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.02%	86'726.68	0.01	a)
XS2433363509	0.2500 % EIB 0 1/4 01/20/32 EARN	60	60	0	120 EUR	82.06%	93'831.19	0.01	a)
XS2436160936	0.1250 % NACN 0 1/8 01/27/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.08%	86'788.62	0.01	a)
XS2438619426	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 02/02/37 EMTN	0	250	0	250 EUR	73.60%	175'335.31	0.02	a)
XS2439543047	0.0500 % EIB 0.05 11/15/29	0	60	0	60 EUR	85.68%	48'983.54	0.00	a)
XS2446841657	0.3750 % EIB 0 3/8 09/15/27 EARN	0	110	0	110 EUR	91.72%	96'139.36	0.01	a)
XS2447602793	2.7500 % POLAND 2 3/4 05/25/32 EMTN	0	50	0	50 EUR	94.69%	45'113.31	0.00	a)
XS2448412879	0.5000 % EDC 0 1/2 02/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.86%	88'482.84	0.01	a)
XS2449505820	0.7500 % RABOBK 0 3/4 03/02/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.83%	79'883.07	0.01	a)
XS2454764429	0.1250 % COE 0 1/8 03/10/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.96%	43'811.20	0.00	a)
XS2456884746	0.3870 % UOBSP 0.387 03/17/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.61%	92'053.30	0.01	a)
XS2461786829	2.3750 % CEZCP 2 3/8 04/06/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.28%	90'792.63	0.01	a)
XS2462455689	0.7500 % SEB 0 3/4 06/28/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.32%	87'973.05	0.01	a)
XS2463550702	1.2500 % BNG 1 1/4 03/30/37 EMTN	0	100	0	100 EUR	79.60%	75'848.56	0.01	a)
XS2465609191	1.0000 % BMO 1 04/05/26	100	0	0	100 EUR	95.06%	90'583.95	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2475954900	1.3750 % KFW 1 3/8 06/07/32	80	60	0	140 EUR	89.71%	119'676.44	0.01	a)
XS2478272938	1.7500 % SBAB 1 3/4 02/10/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.85%	85'619.43	0.01	a)
XS2478523108	1.7500 % SPABOL 1 3/4 05/11/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.54%	85'324.04	0.01	a)
XS2484093393	1.5000 % EIB 1 1/2 06/15/32 EARN	60	50	0	110 EUR	90.28%	94'627.89	0.01	a)
XS2485360981	2.5000 % HERIM 2 1/2 05/25/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.01%	90'528.69	0.01	a)
XS2486449072	1.3750 % LFBANK 1 3/8 05/31/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.24%	89'803.54	0.01	a)
XS2489466446	2.0000 % ASIA 2 06/10/37 GMTN	0	20	0	20 EUR	88.50%	16'866.61	0.00	a)
XS2491074923	2.5520 % BZLNZ 2.552 06/29/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.20%	92'616.45	0.01	a)
XS2498154207	2.0000 % KFW 2 11/15/29	40	60	0	100 EUR	95.84%	91'324.34	0.01	a)
XS2500341990	1.9000 % RENTEN 1.9 07/12/32 EMTN	60	0	0	60 EUR	92.98%	53'157.17	0.00	a)
XS2500674887	1.8750 % BNG 1 7/8 07/13/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.05%	87'711.96	0.01	a)
XS2523326853	2.0000 % BAWAG 2 08/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.81%	86'532.29	0.01	a)
XS2526825463	2.0000 % CCDJ 2 08/31/26 GMTN	100	0	0	100 EUR	96.56%	92'010.42	0.01	a)
XS2526882001	2.3470 % NAB 2.347 08/30/29	0	100	0	100 EUR	95.13%	90'646.84	0.01	a)
XS2528875714	2.5000 % IDAWBG 2 1/2 01/15/38 GMTN	0	80	0	80 EUR	92.61%	70'595.70	0.01	a)
XS2532370231	4.0000 % ESTONI 4 10/12/32	20	0	0	20 EUR	105.18%	20'044.28	0.00	a)
XS2532681074	3.7500 % FERROV 3 3/4 04/14/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.95%	95'236.88	0.01	a)
XS2535352962	2.2500 % EIB 2 1/4 03/15/30 EARN	50	50	0	100 EUR	96.85%	92'287.71	0.01	a)
XS2536375368	2.3750 % HESLAN 2 3/8 09/21/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.99%	93'374.95	0.01	a)
XS2536806289	2.5000 % EIKBOL 2 1/2 09/22/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.05%	92'479.24	0.01	a)
XS2536817484	4.6250 % BGARIA 4 5/8 09/23/34	0	100	0	100 EUR	106.02%	101'020.88	0.01	a)
XS2538441598	6.6250 % ROMANI 6 5/8 09/27/29 REGS	0	40	0	40 EUR	106.98%	40'773.88	0.00	a)
XS2541853532	2.8120 % DBSSP 2.812 10/13/25 EMTN	100	100	0	200 EUR	98.78%	188'255.45	0.02	a)
XS2544645117	3.2460 % CBAAU 3.246 10/24/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.55%	94'857.63	0.01	a)
XS2547591474	3.6020 % SUMIBK 3.602 02/16/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.67%	94'969.12	0.01	a)
XS2553554812	2.7500 % NEDWBK 2 3/4 11/09/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.24%	94'563.19	0.01	a)
XS2558247677	2.7500 % OPBANK 2 3/4 06/22/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.67%	94'018.14	0.01	a)
XS2559401802	2.7500 % SEK 2 3/4 02/23/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.61%	93'959.07	0.01	a)
XS2570759154	3.1250 % BAWAG 3 1/8 01/12/29	0	100	0	100 EUR	99.47%	94'784.26	0.01	a)
XS2574388646	2.8750 % EIB 2 7/8 01/12/33 EARN	100	0	0	100 EUR	99.94%	95'232.12	0.01	a)
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	0	50	0	50 EUR	101.46%	48'339.77	0.00	a)
XS2577104321	2.8750 % KUNTA 2 7/8 01/18/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.71%	95'010.10	0.01	a)
XS2577109049	2.9000 % IBRD 2.9 01/19/33 EMTN	0	80	0	80 EUR	100.01%	76'236.01	0.01	a)
XS2579050639	3.0000 % Q 3 01/24/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.07%	94'399.30	0.01	a)
XS2583211201	4.6250 % AMCOSP 4 5/8 02/06/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.33%	96'554.72	0.01	a)
XS2585966505	3.0000 % INTNED 3 02/15/33	0	100	0	100 EUR	99.37%	94'688.02	0.01	a)
XS2586942448	2.7500 % KFW 2 3/4 02/14/33 EMTN	0	80	0	80 EUR	99.38%	75'761.09	0.01	a)
XS2586944659	3.8750 % POLAND 3 7/8 02/14/33 EMTN	0	40	0	40 EUR	102.42%	39'035.82	0.00	a)
XS2587298204	2.7500 % EIB 2 3/4 07/28/28 EARN	0	100	0	100 EUR	99.73%	95'026.30	0.01	a)
XS2587748174	2.7500 % RENTEN 2 3/4 02/16/32 EMTN	0	60	0	60 EUR	99.12%	56'667.02	0.01	a)
XS2590764713	3.0000 % BNG 3 02/23/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.41%	95'674.26	0.01	a)
XS2591032235	4.1250 % ORSTED 4 1/8 03/01/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.98%	97'174.09	0.01	a)
XS2595029344	3.6250 % RY 3 5/8 03/07/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.42%	96'637.62	0.01	a)
XS2595650222	3.2500 % RENTEN 3 1/4 09/06/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.43%	97'601.94	0.01	a)
XS2597408272	3.7150 % TD 3.715 03/13/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.48%	97'646.72	0.01	a)
XS2597408439	3.8790 % TD 3.879 03/13/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.77%	96'017.29	0.01	a)
XS2606264005	4.0000 % FUMVFH 4 05/26/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.73%	95'982.99	0.01	a)
XS2607079493	3.4370 % ANZ 3.437 04/04/25	0	100	0	100 EUR	99.76%	95'056.79	0.01	a)
XS2611177382	3.1000 % IBRD 3.1 04/14/38 GMTN	0	40	0	40 EUR	99.57%	37'949.91	0.00	a)
XS2613821300	3.0000 % NEDWBK 3 04/20/33	0	100	0	100 EUR	100.46%	95'726.66	0.01	a)
XS2617508481	3.2500 % SBAB 3 1/4 05/03/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.05%	95'335.98	0.01	a)
XS2626022656	3.3750 % RBAIV 3 3/8 09/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.60%	94'910.04	0.01	a)
XS2626024868	2.7500 % EIB 2 3/4 07/30/30 EARN	0	100	0	100 EUR	99.48%	94'795.70	0.01	a)
XS2626288760	2.7500 % KFW 2 3/4 05/15/30 EMTN	0	60	0	60 EUR	99.84%	57'078.67	0.01	a)
XS2632653510	3.5000 % EIBKOR 3 1/2 06/07/26 REGS	0	100	0	100 EUR	99.65%	94'950.06	0.01	a)
XS2647979181	3.0000 % EIB 3 07/15/33 EARN	0	100	0	100 EUR	100.77%	96'017.29	0.01	a)
XS2677519196	3.5000 % DBJP 3 1/2 09/13/27 GMTN	0	100	0	100 EUR	101.13%	96'365.10	0.01	a)
XS2679922828	3.4500 % IBRD 3.45 09/13/38 EMTN	0	50	0	50 EUR	103.46%	49'292.66	0.00	a)
XS2681334962	3.1250 % COE 3 1/8 09/13/28 EMTN	0	50	0	50 EUR	101.20%	48'215.90	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2689948078	6.3750 % ROMANI 6 3/8 09/18/33 REGS	0	50	0	50 EUR	105.24%	50'139.29	0.00	a)
XS2689949399	5.5000 % ROMANI 5 1/2 09/18/28 REGS	0	50	0	50 EUR	102.20%	48'692.34	0.00	a)
XS2698047771	3.2500 % KFW 3 1/4 03/24/31 EMTN	0	50	0	50 EUR	102.77%	48'963.44	0.00	a)
XS2721113160	4.3750 % BYLAN 4 3/8 09/21/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.92%	95'210.20	0.01	a)
XS2725234954	3.3750 % NWISE 3 3/8 11/27/28	0	100	0	100 EUR	100.69%	95'942.97	0.01	a)
XS2726853554	3.1250 % STATK 3 1/8 12/13/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.09%	93'466.42	0.01	a)
EUR							196'958'949.82	18.03	
FR0010763177	6.1250 % EDF 6 1/8 06/02/34 EMTN	50	0	0	50 GBP	102.60%	57'141.71	0.01	a)
FR0010945436	5.1250 % EDF 5 1/8 09/22/50 EMTN	100	0	0	100 GBP	86.72%	96'590.99	0.01	a)
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	342	60	0	402 GBP	108.42%	485'457.06	0.04	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	690	130	0	820 GBP	101.84%	930'182.47	0.09	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	597	170	20	747 GBP	100.25%	834'143.99	0.08	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	532	110	0	642 GBP	100.33%	717'452.61	0.07	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	451	170	60	561 GBP	104.18%	650'971.67	0.06	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	467	100	0	567 GBP	95.38%	602'363.50	0.06	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	414	120	20	514 GBP	95.79%	548'410.98	0.05	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	547	140	0	687 GBP	100.48%	768'850.91	0.07	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	477	100	0	577 GBP	100.22%	644'106.37	0.06	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	705	170	0	875 GBP	104.55%	1'018'994.72	0.09	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	354	70	0	424 GBP	95.44%	450'751.64	0.04	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	415	60	0	475 GBP	98.36%	520'376.21	0.05	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	610	130	0	740 GBP	103.04%	849'323.97	0.08	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	419	70	0	489 GBP	91.60%	498'899.13	0.05	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	440	120	0	560 GBP	97.85%	610'321.24	0.06	a)
GB00B6RHH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	415	110	0	525 GBP	87.54%	511'909.54	0.05	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	489	160	40	609 GBP	83.35%	565'386.02	0.05	a)
GB00BJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	347	80	0	427 GBP	82.60%	392'833.95	0.04	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	515	120	0	635 GBP	53.36%	377'434.28	0.03	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	442	110	60	492 GBP	56.55%	309'897.03	0.03	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	627	230	40	817 GBP	91.02%	828'315.54	0.08	a)
GB00BFMCM52	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	410	60	0	470 GBP	46.50%	243'448.00	0.02	a)
GB00BFVWFL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	590	0	590	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFVWFP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	500	200	90	610 GBP	58.82%	399'659.02	0.04	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	630	140	0	770 GBP	90.03%	772'190.85	0.07	a)
GB00BHFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	605	50	655	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BILROJ16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	400	90	0	490 GBP	52.55%	286'827.62	0.03	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	760	170	40	890 GBP	84.46%	837'305.39	0.08	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	570	200	100	670 GBP	61.23%	456'962.57	0.04	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	730	200	20	910 GBP	95.19%	964'850.66	0.09	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	670	160	50	780 GBP	79.21%	688'136.48	0.06	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	490	220	0	710 GBP	92.43%	730'984.35	0.07	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	240	450	30	660 GBP	99.60%	732'208.92	0.07	a)
GB00BLDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	170	40	0	210 GBP	36.85%	86'195.42	0.01	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	480	90	0	570 GBP	49.03%	311'282.91	0.03	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	610	140	30	720 GBP	96.01%	769'990.55	0.07	a)
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	330	310	60	580 GBP	84.37%	545'052.42	0.05	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	290	180	0	470 GBP	64.56%	337'952.08	0.03	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	240	430	90	580 GBP	75.12%	485'313.66	0.04	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	600	110	0	710 GBP	79.68%	630'152.92	0.06	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	190	160	0	350 GBP	51.23%	199'734.78	0.02	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	390	160	0	550 GBP	30.00%	183'773.28	0.02	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	530	130	0	660 GBP	40.35%	296'593.09	0.03	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	510	110	0	620 GBP	85.85%	592'856.04	0.05	a)
GB00BMF9LF76	4.0000 % UKT 4 10/22/63	0	290	70	220 GBP	91.35%	223'855.68	0.02	a)
GB00BMF9LG83	4.5000 % UKT 4 1/2 06/07/28	0	450	0	450 GBP	101.39%	508'185.38	0.05	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	320	0	320	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	680	140	0	820 GBP	76.20%	695'997.38	0.06	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	580	110	0	690 GBP	67.98%	522'488.57	0.05	a)
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	60	620	0	680 GBP	94.00%	711'996.74	0.07	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	490	90	0	580 GBP	86.05%	555'925.18	0.05	a)
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	560	100	0	660 GBP	90.51%	665'384.50	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	390	90	0	480	49.69%	265'672.35	0.02	a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	0	720	0	720	98.31%	788'403.85	0.07	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	100	460	0	560	87.11%	543'360.93	0.05	a)
GB00BPJJKN53	4.6250 % UKT 4 5/8 01/31/34	0	230	0	230	104.10%	266'689.52	0.02	a)
GB00BPJJKP77	4.7500 % UKT 4 3/4 10/22/43	0	130	0	130	103.03%	149'189.63	0.01	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	110	250	0	360	93.80%	376'133.47	0.03	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	690	130	0	820	96.32%	879'765.09	0.08	a)
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	341	70	0	411	63.98%	292'896.00	0.03	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	720	190	30	880	93.94%	920'760.62	0.08	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	530	180	50	660	74.04%	544'328.64	0.05	a)
US880591DP40	5.6250 % TVA 5 5/8 06/07/32	10	0	0	10	105.50%	11'751.25	0.00	a)
XS0085727559	6.0000 % EIB 6 12/07/28	70	0	0	70	107.27%	83'634.11	0.01	a)
XS0089572316	6.0000 % ITALY 6 08/04/28 EMTN	60	0	0	60	102.21%	68'308.74	0.01	a)
XS0091740018	5.6250 % EBRD 5 5/8 12/07/28 EMTN	50	0	0	50	105.12%	58'545.72	0.01	a)
XS0094804126	4.5000 % LCRFIN 4 1/2 12/07/28 REGS	30	0	0	30	100.38%	33'541.86	0.00	a)
XS0095130943	4.8750 % IBRD 4 7/8 12/07/28 EMTN	10	0	0	10	102.47%	11'413.53	0.00	a)
XS0096412548	5.2500 % RESFER 5 1/4 12/07/28 EMTN	50	0	0	50	102.85%	57'278.15	0.01	a)
XS0096499057	5.0000 % EIB 5 04/15/39	30	0	0	30	105.20%	35'153.83	0.00	a)
XS0096806590	5.2000 % BNG 5.2 12/07/28 EMTN	50	0	0	50	102.54%	57'106.62	0.01	a)
XS0110373569	5.5000 % EIB 5 1/2 04/15/25	60	0	0	60	100.48%	67'153.90	0.01	a)
XS0114126294	5.6250 % EIB 5 5/8 06/07/32	50	0	0	50	110.15%	61'345.38	0.01	a)
XS0123656836	5.2500 % RESFER 5 1/4 01/31/35 EMTN	10	0	0	10	104.40%	11'628.83	0.00	a)
XS0130092793	5.3750 % NEDWBK 5 3/8 06/07/32 EMTN	50	0	0	50	106.66%	59'400.04	0.01	a)
XS0138036842	5.5000 % KFW 5 1/2 06/18/25 EXC	50	0	0	50	100.65%	56'056.82	0.01	a)
XS0138037733	6.0000 % KFW 6 12/07/28 EXCH	80	0	0	80	107.20%	95'523.03	0.01	a)
XS0138038624	5.7500 % KFW 5 3/4 06/07/32 EXCH	60	0	0	60	110.62%	73'926.56	0.01	a)
XS0138039275	5.0000 % KFW 5 06/09/36 EMTN	30	0	0	30	106.12%	35'459.58	0.00	a)
XS0144628053	5.3750 % SNCF 5 3/8 03/18/27 EMTN	10	0	0	10	101.13%	11'264.27	0.00	a)
XS0150670551	5.1000 % LCRFIN 5.1 03/07/51	40	0	0	40	105.40%	46'959.10	0.00	a)
XS0202407093	4.6250 % EIB 4 5/8 10/12/54 DIP	30	0	0	30	99.66%	33'303.28	0.00	a)
XS0206361221	4.7500 % UKRAIL 4 3/4 11/29/35 EMTN	50	0	0	50	102.16%	56'896.66	0.01	a)
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	30	0	0	30	99.51%	33'252.82	0.00	a)
XS0211898043	4.9990 % BRDGT 4.999 10/05/31 B	50	0	0	50	95.78%	53'341.80	0.00	a)
XS0236698972	4.3750 % UKRAIL 4 3/8 12/09/30 EMTN	50	0	0	50	100.26%	55'836.83	0.01	a)
XS0415532273	4.5000 % EIB 4 1/2 06/07/29 EMTN	20	0	0	20	101.17%	22'537.45	0.00	a)
XS0416848793	6.8750 % EQNR 6 7/8 03/11/31 EMTN	0	50	0	50	112.95%	62'903.66	0.01	a)
XS0499449261	5.7500 % ORSTED 5 3/4 04/09/40 EMTN	50	0	0	50	101.56%	56'559.72	0.01	a)
XS0584363724	5.6250 % NVIDE 5 5/8 01/28/26 EMTN	100	0	0	100	101.02%	112'523.53	0.01	a)
XS0596191360	5.7500 % SANUK 5 3/4 03/02/26 EMTN	100	0	0	100	101.30%	112'835.41	0.01	a)
XS0740808802	3.8750 % EIB 3 7/8 06/08/37 EMTN	0	20	0	20	94.60%	21'074.52	0.00	a)
XS0895820834	4.8820 % ARQIVA 4.882 12/31/32 EMTN	100	0	0	100	95.78%	64'015.10	0.01	a)
XS0954706023	3.1250 % DBHNGR 3 1/8 07/24/26 EMTN	100	0	0	100	96.40%	107'369.74	0.01	a)
XS1188135450	2.1250 % DEXGRP 2 1/8 02/12/25 EMTN	100	0	0	100	97.19%	108'256.36	0.01	a)
XS1273543162	2.8930 % AHFILN 2.893 08/11/43	100	0	0	100	76.36%	85'048.15	0.01	a)
XS1490724975	1.0000 % EIB 1 09/21/26 EMTN	70	0	0	70	91.71%	71'502.04	0.01	a)
XS1805260483	1.3750 % EIB 1 3/8 03/07/25 EMTN	50	0	0	50	96.46%	53'719.95	0.00	a)
XS1811047080	1.6250 % BNG 1 5/8 08/26/25 EMTN	100	0	0	100	95.26%	106'099.95	0.01	a)
XS1870443089	1.3750 % IFC 1 3/8 03/07/25	50	0	0	50	96.44%	53'707.70	0.00	a)
XS1872363558	1.3750 % RENTEN 1 3/8 09/08/25 EMTN	50	0	0	50	94.89%	52'843.91	0.00	a)
XS1941813617	1.3750 % KFW 1 3/8 12/09/24 EMTN	150	0	0	150	97.24%	162'471.42	0.01	a)
XS1950499712	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 02/13/26 EMTN	70	0	0	70	94.65%	73'794.35	0.01	a)
XS1991124063	1.2500 % IADB 1 1/4 12/15/25	100	0	0	100	94.02%	104'719.88	0.01	a)
XS2034715305	0.8750 % KFW 0 7/8 09/15/26 EMTN	0	30	0	30	91.44%	30'553.51	0.00	a)
XS2110832040	0.7500 % EIB 0 3/4 07/22/27 EMTN	0	50	0	50	88.72%	49'410.46	0.00	a)
XS2121223601	0.7500 % IFC 0 3/4 07/22/27 GMTN	50	0	0	50	88.66%	49'377.05	0.00	a)
XS2122575678	1.0000 % IBRD 1 12/21/29	50	0	0	50	83.71%	46'618.59	0.00	a)
XS2236022153	0.2500 % IBRD 0 1/4 09/23/27 GMTN	100	0	0	100	86.60%	96'461.79	0.01	a)
XS2245488775	0.2000 % AIIB 0.2 12/15/25 GMTN	50	0	0	50	92.22%	51'359.70	0.00	a)
XS2281478268	0.1250 % KFW 0 1/8 12/30/26 EMTN	0	20	0	20	88.67%	19'753.94	0.00	a)
XS2284257701	0.1250 % NIB 0 1/8 12/15/26 EMTN	0	30	0	30	88.64%	29'618.21	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2297687787	0.3750 % IDAWBG 0 3/8 09/22/27	100	0	0	100 GBP	86.63%	96'490.75	0.01	a)
XS2318615569	0.3750 % KUNTA 0 3/8 12/17/25 EMTN	0	100	0	100 GBP	92.40%	102'919.90	0.01	a)
XS2332979769	0.7500 % ASIA 0 3/4 12/07/27	100	0	0	100 GBP	87.65%	97'629.10	0.01	a)
XS2356217203	0.5000 % AFDB 0 1/2 06/22/26 GMTN	0	20	0	20 GBP	91.11%	20'296.61	0.00	a)
XS2389689337	0.6250 % LBANK 0 5/8 12/15/25 EMTN	0	20	0	20 GBP	92.82%	20'677.32	0.00	a)
XS2398918024	0.8750 % EIB 0 7/8 05/15/26	0	20	0	20 GBP	92.36%	20'573.96	0.00	a)
XS2430947049	1.1250 % ASIA 1 1/8 06/10/25	0	20	0	20 GBP	95.38%	21'247.61	0.00	a)
XS2431006233	1.2500 % IBRD 1 1/4 12/13/28	0	30	0	30 GBP	87.25%	29'154.73	0.00	a)
XS2573690489	4.1250 % KFW 4 1/8 02/18/26 EMTN	0	30	0	30 GBP	99.06%	33'100.11	0.00	a)
XS2574080789	4.2500 % COE 4 1/4 03/16/26 EMTN	0	50	0	50 GBP	98.90%	55'078.30	0.01	a)
XS2578472412	3.8750 % NIB 3 7/8 02/19/26 EMTN	0	30	0	30 GBP	98.41%	32'885.25	0.00	a)
XS2583600015	3.8750 % ASIA 3 7/8 02/10/26 GMTN	0	50	0	50 GBP	98.43%	54'815.43	0.01	a)
XS2594034998	4.0000 % IADB 4 12/17/29 GMTN	0	20	0	20 GBP	98.33%	21'904.12	0.00	a)
GBP							36'312'612.06	3.32	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	400	0	0	400 ILS	106.11%	104'641.45	0.01	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	350	0	0	350 ILS	111.23%	95'978.39	0.01	a)
IL0011308488	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/24 0324	470	0	470	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	600	0	0	600 ILS	97.07%	143'593.16	0.01	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	400	0	0	400 ILS	94.81%	93'499.03	0.01	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	480	0	0	480 ILS	86.76%	102'671.07	0.01	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	220	220	0	440 ILS	93.13%	101'028.26	0.01	a)
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	670	0	0	670 ILS	84.11%	138'940.91	0.01	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	300	120	0	420 ILS	96.33%	99'748.75	0.01	a)
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	300	150	0	450 ILS	70.64%	78'371.90	0.01	a)
IL0011746976	0.5000 % ILGOV 0 1/2 02/27/26 0226	0	300	0	300 ILS	93.76%	69'345.63	0.01	a)
IL0011806606	1.3000 % ILGOV 1.3 04/30/32 0432	0	400	0	400 ILS	80.60%	79'481.39	0.01	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	0	130	0	130 ILS	69.45%	22'259.03	0.00	a)
IL0011948028	3.7500 % ILGOV 3 3/4 02/28/29 0229	0	250	0	250 ILS	99.23%	61'159.72	0.01	a)
ILS							1'190'718.69	0.11	
JP525022AM69	0.5140 % ACAFP 0.514 07/06/27 9	100'000	0	0	100'000 JPY	98.49%	579'444.25	0.05	a)
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	0	100'000	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JPY							579'444.25	0.05	
KR10350172C8	3.0000 % KTB 3 12/10/42 4212	450'000	0	0	450'000 KRW	93.27%	277'530.25	0.03	a)
KR103501G562	2.2500 % KTB 2 1/4 06/10/25 2506	670'000	0	0	670'000 KRW	98.50%	436'392.06	0.04	a)
KR103501G935	1.8750 % KTB 1 7/8 03/10/24 2403	630'000	0	630'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR103501G992	1.3750 % KTB 1 3/8 09/10/24 2409	300'000	0	0	300'000 KRW	98.98%	196'358.06	0.02	a)
KR103501GA35	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/25 2503	500'000	0	0	500'000 KRW	98.07%	324'254.43	0.03	a)
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	600'000	600'000	0	1'200'000 KRW	96.57%	766'301.42	0.07	a)
KR103501GB34	1.2500 % KTB 1 1/4 03/10/26 2603	600'000	700'000	0	1'300'000 KRW	95.80%	823'505.60	0.08	a)
KR103501GB67	1.1250 % KTB 1 1/8 06/10/24 2406	500'000	0	500'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR10350270C0	4.7500 % KTB 4 3/4 12/10/30 3012	250'000	0	0	250'000 KRW	107.40%	177'557.23	0.02	a)
KR10350271C8	4.0000 % KTB 4 12/10/31 3112	340'000	0	0	340'000 KRW	103.32%	232'288.92	0.02	a)
KR103502G3C1	3.7500 % KTB 3 3/4 12/10/33 3312	350'000	0	0	350'000 KRW	102.10%	236'305.02	0.02	a)
KR103502G495	3.0000 % KTB 3 09/10/24 2409	380'000	0	380'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR103502G4C9	2.7500 % KTB 2 3/4 12/10/44 4412	300'000	0	0	300'000 KRW	90.01%	178'557.57	0.02	a)
KR103502G594	2.6250 % KTB 2 5/8 09/10/35 3509	400'000	0	0	400'000 KRW	92.15%	243'751.04	0.02	a)
KR103502G5C6	2.2500 % KTB 2 1/4 12/10/25 2512	600'000	0	0	600'000 KRW	97.95%	388'636.51	0.04	a)
KR103502G636	2.0000 % KTB 2 03/10/46 4603	280'000	0	0	280'000 KRW	78.11%	144'628.64	0.01	a)
KR103502G669	1.8750 % KTB 1 7/8 06/10/26 2606	400'000	0	0	400'000 KRW	96.64%	255'617.99	0.02	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	150'000	0	0	150'000 KRW	80.00%	79'347.65	0.01	a)
KR103502G6C4	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/26 2612	600'000	1'000'000	0	1'600'000 KRW	94.90%	1'004'083.30	0.09	a)
KR103502G735	2.1250 % KTB 2 1/8 03/10/47 4703	300'000	0	0	300'000 KRW	79.45%	157'613.46	0.01	a)
KR103502G768	2.1250 % KTB 2 1/8 06/10/27 2706	600'000	0	0	600'000 KRW	95.96%	380'723.74	0.03	a)
KR103502G792	2.2500 % KTB 2 1/4 09/10/37 3709	300'000	0	0	300'000 KRW	87.05%	172'692.27	0.02	a)
KR103502G7C2	2.3750 % KTB 2 3/8 12/10/27 2712	200'000	0	0	200'000 KRW	96.28%	127'329.37	0.01	a)
KR103502G867	2.6250 % KTB 2 5/8 06/10/28 2806	200'000	0	0	200'000 KRW	96.70%	127'887.05	0.01	a)
KR103502G8C0	2.3750 % KTB 2 3/8 12/10/28 2812	250'000	0	0	250'000 KRW	95.23%	157'424.23	0.01	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	450'000	0	0	450'000 KRW	76.75%	228'385.96	0.02	a)
KR103502G966	1.8750 % KTB 1 7/8 06/10/29 2906	750'000	0	0	750'000 KRW	92.32%	457'858.59	0.04	a)
KR103502G990	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/39 3909	0	1'200'000	0	1'200'000 KRW	72.19%	572'816.46	0.05	a)
KR103502G9C8	1.3750 % KTB 1 3/8 12/10/29 2912	400'000	400'000	0	800'000 KRW	89.11%	471'404.55	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
KR103502GA34	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/50 5003	1'000'000	1'300'000	0	2'300'000 KRW	70.38%	1'070'473.00	0.10	a)
KR103502GA67	1.3750 % KTB 1 3/8 06/10/30 3006	550'000	0	0	550'000 KRW	88.10%	320'435.46	0.03	a)
KR103502GA91	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/40 4009	300'000	0	0	300'000 KRW	75.42%	149'621.35	0.01	a)
KR103502GAC2	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/30 3012	0	800'000	0	800'000 KRW	87.98%	465'412.58	0.04	a)
KR103502GB33	1.8750 % KTB 1 7/8 03/10/51 5103	1'400'000	300'000	0	1'700'000 KRW	74.05%	832'394.90	0.08	a)
KR103502GB66	2.0000 % KTB 2 06/10/31 3106	600'000	0	0	600'000 KRW	90.31%	358'313.29	0.03	a)
KR103502GBC0	2.3750 % KTB 2 3/8 12/10/31 3112	0	400'000	0	400'000 KRW	92.31%	244'168.35	0.02	a)
KR103502GC99	3.1250 % KTB 3 1/8 09/10/52 5209	300'000	0	0	300'000 KRW	94.90%	188'268.23	0.02	a)
KR103503GA90	1.6250 % KTB 1 5/8 09/10/70 7009	0	500'000	0	500'000 KRW	59.15%	195'574.38	0.02	a)
KRW							12'443'912.91	1.14	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	53'500	0	53'500	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000082	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	20'000	0	0	20'000 MXN	106.33%	109'723.45	0.01	a)
MX0MGO000088	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	56'500	12'000	0	68'500 MXN	94.51%	334'024.17	0.03	a)
MX0MGO000099	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	45'500	7'000	0	52'500 MXN	97.26%	263'442.15	0.02	a)
MX0MGO000105	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	33'500	11'000	0	44'500 MXN	94.23%	216'346.33	0.02	a)
MX0MGO000122	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	76'000	8'000	0	84'000 MXN	92.54%	401'068.30	0.04	a)
MX0MGO000138	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	47'500	14'000	0	61'500 MXN	86.36%	274'039.01	0.03	a)
MX0MGO000154	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	12'800	8'000	0	20'800 MXN	90.35%	96'962.96	0.01	a)
MX0MGO000170	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	95'000	0	0	95'000 MXN	92.48%	453'309.76	0.04	a)
MX0MGO000186	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	44'500	6'000	0	50'500 MXN	87.57%	228'176.63	0.02	a)
MX0MGO000202	8.0000 % MBONO 8 09/05/24 M	56'000	0	56'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000218	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	0	26'000	0	26'000 MXN	93.94%	126'023.62	0.01	a)
MX0MGO000234	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	0	20'000	0	20'000 MXN	95.19%	98'230.09	0.01	a)
MX0MGO000250	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	35'000	35'000	0	70'000 MXN	89.73%	324'060.35	0.03	a)
MX0MGO000266	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	12'000	49'000	0	61'000 MXN	89.70%	282'319.91	0.03	a)
MX0MGO000282	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	15'000	22'000	0	37'000 MXN	86.79%	165'686.06	0.02	a)
MX0MGO000298	8.5000 % MBONO 8 1/2 03/01/29 M	0	17'500	0	17'500 MXN	97.00%	87'585.61	0.01	a)
MXM5GO000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	0	5'000	0	5'000 MXN	91.32%	23'558.64	0.00	a)
MXN							3'484'557.04	0.32	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	1'030	0	1'030	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	1'070	0	0	1'070 NOK	97.39%	86'570.14	0.01	a)
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	820	0	0	820 NOK	95.22%	64'865.20	0.01	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	780	300	0	1'080 NOK	94.00%	84'339.39	0.01	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	650	300	0	950 NOK	93.08%	73'457.39	0.01	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	1'150	0	0	1'150 NOK	90.04%	86'021.57	0.01	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	0	500	0	500 NOK	86.38%	35'880.38	0.00	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	950	0	0	950 NOK	83.42%	65'838.19	0.01	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	1'000	0	0	1'000 NOK	88.14%	73'220.42	0.01	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	0	300	0	300 NOK	99.09%	24'695.44	0.00	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	0	1'000	0	1'000 NOK	93.76%	77'891.82	0.01	a)
NO0013052928	4.6400 % OSLO 4.64 10/19/28	0	1'000	0	1'000 NOK	100.13%	83'180.48	0.01	a)
X51805263743	1.8750 % NIB 1 7/8 04/10/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
X52689964869	4.2500 % KFW 4 1/4 09/29/28 EMTN	0	500	0	500 NOK	100.17%	41'609.76	0.00	a)
NOK							797'570.18	0.07	
NZADBDT007C4	3.5000 % ASIA 3 1/2 05/30/24 MTN	200	0	200	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZADBDT016C5	4.0000 % ASIA 4 05/27/27 MTN	0	60	0	60 NZD	97.38%	31'344.52	0.00	a)
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	250	50	0	300 NZD	97.26%	156'534.31	0.01	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	240	100	0	340 NZD	99.59%	181'659.16	0.02	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	230	100	0	330 NZD	92.91%	164'490.18	0.02	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	200	150	0	350 NZD	91.08%	171'013.77	0.02	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	200	0	0	200 NZD	79.49%	85'292.03	0.01	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	234	0	234	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	120	50	0	170 NZD	91.15%	83'125.85	0.01	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	150	80	0	230 NZD	83.65%	103'213.89	0.01	a)
NZGOVDT530C2	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/30 0530	0	100	0	100 NZD	99.51%	53'386.25	0.00	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	200	60	0	260 NZD	81.04%	113'041.63	0.01	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	100	70	0	170 NZD	81.98%	74'767.30	0.01	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	0	60	0	60 NZD	95.93%	30'879.08	0.00	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	70	60	0	130 NZD	63.07%	43'982.64	0.00	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	100	0	0	100 NZD	67.31%	36'110.67	0.00	a)
NZHNZD0001L7	2.2470 % HOUSNZ 2.247 10/05/26	100	0	0	100 NZD	93.23%	50'013.96	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NZHNZD0628L7	3.4200 % HOUSNZ 3.42 10/18/28 MTN	0	100	0	100 NZD	93.55%	50'186.71	0.00	a)
NZIBDDT018C3	1.6250 % IBRD 1 5/8 05/10/28 MTN	0	40	0	40 NZD	87.93%	18'868.26	0.00	a)
NZIBDDT019C1	2.8750 % IBRD 2 7/8 11/30/26 MTN	0	50	0	50 NZD	94.77%	25'420.34	0.00	a)
NZIBDDT022C5	5.0000 % IBRD 5 06/22/26 MTN	0	80	0	80 NZD	99.97%	42'906.85	0.00	a)
NZLGFDT007C4	4.5000 % NZLGFA 4 1/2 04/15/27	30	0	0	30 NZD	98.39%	15'835.62	0.00	a)
NZLGFDT008C2	2.7500 % NZLGFA 2 3/4 04/15/25	150	0	0	150 NZD	96.91%	77'987.12	0.01	a)
NZLGFDT009C0	3.5000 % NZLGFA 3 1/2 04/14/33	0	60	0	60 NZD	86.93%	27'982.76	0.00	a)
NZLGFDT011C6	2.2500 % NZLGFA 2 1/4 04/15/24	50	0	50	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZLGFDT012C4	1.5000 % NZLGFA 1 1/2 04/20/29	0	100	0	100 NZD	84.24%	45'191.59	0.00	a)
NZLGFDT020C7	4.5000 % NZLGFA 4 1/2 05/15/30	0	60	0	60 NZD	96.95%	31'207.08	0.00	a)
NZLRBDT009C1	5.3750 % RENTEN 5 3/8 04/23/24 MTN	40	0	40	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZWZND0724L3	2.2200 % WSTPNZ 2.22 07/29/24 MTN	100	0	0	100 NZD	98.57%	52'878.74	0.00	a)
NZD							1'767'320.31	0.16	
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	560	0	0	560 PLN	91.46%	113'092.48	0.01	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	160	0	0	160 PLN	97.56%	34'465.08	0.00	a)
PL0000108866	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/26 0726	1'240	0	0	1'240 PLN	94.34%	258'290.78	0.02	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	1'180	0	0	1'180 PLN	92.16%	240'118.06	0.02	a)
PL0000109765	4.0000 % POLGB 4 04/25/47 0447	0	0	0	80 PLN	81.51%	14'398.10	0.00	a)
PL0000111191	2.5000 % POLGB 2 1/2 04/25/24 0424	430	0	430	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	1'200	0	0	1'200 PLN	88.56%	234'664.96	0.02	a)
PL0000111720	2.2500 % POLGB 2 1/4 10/25/24 1024	1'000	0	0	1'000 PLN	98.35%	217'157.73	0.02	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	700	0	0	700 PLN	95.34%	147'353.41	0.01	a)
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	900	1'500	0	2'400 PLN	78.45%	415'705.99	0.04	a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	350	600	0	950 PLN	88.37%	185'375.77	0.02	a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	0	640	0	640 PLN	77.26%	109'178.93	0.01	a)
PL0000115283	0.0000 % POLGB 0 10/25/25 1025	0	500	0	500 PLN	92.19%	101'779.16	0.01	a)
XS1492818866	2.7500 % EIB 2 3/4 08/25/26 EMTN	0	200	0	200 PLN	94.08%	41'546.31	0.00	a)
XS1622379698	3.0000 % EIB 3 05/24/24 EMTN	150	0	150	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
XS1963719585	3.0000 % EIB 3 11/25/29 EMTN	0	400	0	400 PLN	88.02%	77'740.30	0.01	a)
PLN							2'190'867.06	0.20	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	820	200	0	1'020 SEK	110.55%	95'953.31	0.01	a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	550	400	0	950 SEK	98.39%	79'541.77	0.01	a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	1'210	300	0	1'510 SEK	99.11%	127'353.45	0.01	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	1'350	300	0	1'650 SEK	95.41%	133'972.83	0.01	a)
SE0009383664	2.0000 % SBAB 2 06/17/26 #147 147	1'000	0	0	1'000 SEK	96.84%	82'410.86	0.01	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	1'050	350	0	1'400 SEK	92.80%	110'557.28	0.01	a)
SE0010298190	1.5000 % LFBANK 1 1/2 09/18/24 #517 517	500	0	0	500 SEK	98.64%	41'968.76	0.00	a)
SE0010469205	1.0000 % KOMINS 1 10/02/24 #2410 2410	400	0	0	400 SEK	98.29%	33'456.21	0.00	a)
SE0011062892	2.0000 % SHBASS 2 09/01/28 #1594 1594	1'000	0	0	1'000 SEK	94.50%	80'421.26	0.01	a)
SE0011063015	1.5000 % SHBASS 1 1/2 03/01/24 #1588 1588	2'000	0	2'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	550	500	0	1'050 SEK	90.84%	81'165.74	0.01	a)
SE0011309244	1.2500 % LFBANK 1 1/4 09/17/25 #518 518	600	0	0	600 SEK	96.45%	49'244.32	0.00	a)
SE0011414010	1.0000 % KOMINS 1 05/12/25 #2505 2505	1'500	0	0	1'500 SEK	96.93%	123'724.79	0.01	a)
SE0011643386	1.5000 % SHBASS 1 1/2 12/03/24 #1589 1589	2'000	0	0	2'000 SEK	98.19%	167'112.56	0.02	a)
SE0012142206	1.0000 % SWEDA 1 09/18/24 #194 194	1'800	0	0	1'800 SEK	98.38%	150'690.81	0.01	a)
SE0012193621	1.0000 % SEB 1 12/18/24 #579 579	2'000	0	0	2'000 SEK	97.72%	166'310.93	0.02	a)
SE0012230415	1.0000 % NDAFH 1 09/18/24 #5534 5534	2'900	0	2'900	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0012324341	1.5000 % LFBANK 1 1/2 09/16/26 #519 519	800	0	0	800 SEK	95.40%	64'945.63	0.01	a)
SE0012569572	1.0000 % KOMINS 1 11/12/26 #2611 2611	1'000	0	0	1'000 SEK	94.21%	80'170.22	0.01	a)
SE0012676690	1.0000 % SHBASS 1 09/03/25 #1590 1590	2'000	0	0	2'000 SEK	96.19%	163'705.22	0.01	a)
SE0013102043	0.5000 % SEB 0 1/2 12/16/26 #581 581	2'000	0	0	2'000 SEK	92.45%	157'348.38	0.01	a)
SE0013358439	0.5000 % NDAFH 0 1/2 09/16/26 #5536 5536	0	2'000	0	2'000 SEK	93.03%	158'327.01	0.01	a)
SE0013358447	1.0000 % NDAFH 1 06/16/27 #5537 5537	0	2'000	0	2'000 SEK	92.80%	157'945.77	0.01	a)
SE0013381571	0.5000 % SBAB 0 1/2 06/11/25 #146 146	2'000	0	0	2'000 SEK	96.06%	163'485.67	0.01	a)
SE0013882644	0.5000 % SHBASS 0 1/2 06/01/26 #1591 1591	2'000	0	0	2'000 SEK	93.72%	159'513.28	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SE0013883238	1.0000 % SHBASS 1 03/01/27 #1592 1592	2'000	0	0	2'000 SEK	93.37%	158'912.49	0.01	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	1'000	0	0	1'000 SEK	84.79%	72'156.52	0.01	a)
SE0015193313	0.5000 % SGB 0 1/2 11/24/45 #1063 1063	500	0	0	500 SEK	64.47%	27'432.70	0.00	a)
SE0015660139	0.7500 % KOMINS 0 3/4 05/12/28 #2805 2805	0	800	0	800 SEK	90.57%	61'655.39	0.01	a)
SE0015987540	0.5000 % DANBNK 0 1/2 12/16/26 #2612 2612	0	2'000	0	2'000 SEK	92.41%	157'278.60	0.01	a)
SE0016829048	0.5000 % KOMINS 0 1/2 06/15/27 #2706 2706	0	600	0	600 SEK	91.64%	46'787.87	0.00	a)
SE0017780430	3.0000 % SEB 3 11/06/28 #602 602	0	2'000	0	2'000 SEK	98.51%	167'667.40	0.02	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	0	900	0	900 SEK	93.71%	71'770.26	0.01	a)
SE0019175548	3.0000 % SWEDA 3 03/15/28 #198 198	0	1'000	0	1'000 SEK	98.82%	84'091.55	0.01	a)
X51171476143	1.2500 % EIB 1 1/4 05/12/25 EMTN	700	0	0	700 SEK	97.12%	57'853.80	0.01	a)
X51562583937	2.2400 % ELLEVI 2.24 02/28/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
X51751359016	1.3750 % EIB 1 3/8 05/12/28 EMTN	800	0	0	800 SEK	92.87%	63'225.28	0.01	a)
X51764081110	1.3750 % KFW 1 3/8 02/02/28 EMTN	600	0	0	600 SEK	93.38%	47'677.83	0.00	a)
X52078928665	0.4325 % IBRD 0.4325 11/12/26 GDIF	2'000	0	0	2'000 SEK	92.71%	157'782.39	0.01	a)
X52226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	1'000	0	0	1'000 SEK	86.02%	73'202.37	0.01	a)
SEK							3'876'820.51	0.35	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	160	0	0	160 SGD	98.64%	103'353.49	0.01	a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	150	0	0	150 SGD	95.12%	93'434.17	0.01	a)
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	140	0	0	140 SGD	97.55%	89'440.46	0.01	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	110	100	0	210 SGD	91.27%	125'522.77	0.01	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	120	50	0	170 SGD	98.34%	109'476.87	0.01	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	106	50	0	156 SGD	95.88%	97'952.05	0.01	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	75	100	0	175 SGD	102.34%	117'280.93	0.01	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	110	50	0	160 SGD	98.88%	103'604.96	0.01	a)
SG71C4000008	2.5980 % HDBSP 2.598 10/30/29 MTN	250	0	0	250 SGD	96.27%	157'604.76	0.01	a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	222	0	0	222 SGD	101.08%	146'947.41	0.01	a)
SG7S30941627	3.0000 % SIGB 3 09/01/24	235	0	135	100 SGD	99.65%	65'259.98	0.01	a)
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	165	0	0	165 SGD	98.66%	106'603.82	0.01	a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	70	60	0	130 SGD	95.11%	80'972.03	0.01	a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	100	0	0	100 SGD	91.18%	59'711.85	0.01	a)
SGXF17096524	2.6250 % HDBSP 2 5/8 09/17/25 MTN	250	0	0	250 SGD	98.51%	161'273.72	0.01	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	130	0	0	130 SGD	78.90%	67'170.92	0.01	a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	80	50	0	130 SGD	95.37%	81'190.82	0.01	a)
SGXF33080817	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/27	0	50	0	50 SGD	99.33%	32'523.90	0.00	a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	80	40	0	120 SGD	96.56%	75'883.68	0.01	a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	60	40	0	100 SGD	100.04%	65'513.42	0.01	a)
SGXF51035222	2.8750 % SIGB 2 7/8 08/01/28	0	80	0	80 SGD	99.36%	52'056.05	0.00	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	100	0	0	100 SGD	90.35%	59'169.61	0.01	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	0	110	0	110 SGD	79.20%	57'052.32	0.01	a)
SGXF92110679	2.0000 % SIGB 2 02/01/24	100	0	100	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SGXF99041406	2.1640 % HDBSP 2.164 05/22/24 MTN	250	0	250	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SGD							2'108'999.99	0.19	
TH0623035C07	3.8500 % THAIGB 3.85 12/12/25	13'600	0	0	13'600 THB	102.97%	343'824.64	0.03	a)
TH0623036C06	2.1250 % THAIGB 2 1/8 12/17/26	6'600	0	0	6'600 THB	99.91%	161'899.22	0.01	a)
TH0623037601	1.0000 % THAIGB 1 06/17/27	10'000	0	0	10'000 THB	96.24%	236'283.97	0.02	a)
TH0623037C05	3.5800 % THAIGB 3.58 12/17/27	5'800	0	0	5'800 THB	104.86%	149'318.19	0.01	a)
TH0623038C04	2.8750 % THAIGB 2 7/8 12/17/28	5'500	0	0	5'500 THB	102.89%	138'936.00	0.01	a)
TH0623039607	4.8750 % THAIGB 4 7/8 06/22/29	4'150	0	0	4'150 THB	112.88%	115'012.33	0.01	a)
TH0623039C03	1.6000 % THAIGB 1.6 12/17/29	5'000	0	0	5'000 THB	96.31%	118'232.83	0.01	a)
TH062303D603	3.3500 % THAIGB 3.35 06/17/33	0	3'000	0	3'000 THB	106.46%	78'414.98	0.01	a)
TH062303G606	3.4000 % THAIGB 3.4 06/17/36	8'700	0	0	8'700 THB	106.85%	228'221.53	0.02	a)
TH062303H604	3.6000 % THAIGB 3.6 06/17/67	11'000	0	0	11'000 THB	99.69%	269'232.47	0.02	a)
TH062303HC09	4.2600 % THAIGB 4.26 12/12/37	2'300	2'000	0	4'300 THB	113.50%	119'820.79	0.01	a)
TH062303I602	3.3000 % THAIGB 3.3 06/17/38	7'000	0	0	7'000 THB	105.63%	181'541.83	0.02	a)
TH062303O600	4.6750 % THAIGB 4.675 06/29/44	6'100	0	0	6'100 THB	125.23%	187'556.35	0.02	a)
TH062303Q605	2.8750 % THAIGB 2 7/8 06/17/46	3'000	5'000	0	8'000 THB	96.48%	189'504.46	0.02	a)
TH0623A3B608	3.6500 % THAIGB 3.65 06/20/31	4'000	0	0	4'000 THB	108.33%	106'382.91	0.01	a)
TH0623A3C606	3.7750 % THAIGB 3.775 06/25/32	5'500	0	0	5'500 THB	109.73%	148'175.09	0.01	a)
TH0623B3B607	4.8500 % THAIGB 4.85 06/17/61	0	3'000	0	3'000 THB	127.57%	93'963.63	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
TH0623X3BC03	2.0000 % THAIGB 2 12/17/31	7'000	0	0	7'000 THB	96.97%	166'649.94	0.02	a)
THB							3'032'971.16	0.28	
FR0014001L06	0.6250 % AGFRNC 0 5/8 01/22/26 EMTN	0	200	0	200 USD	92.44%	162'796.08	0.01	a)
RU000A0JWHA4	4.7500 % RUSSIA 4 3/4 05/27/26 REGS	200	0	0	200 USD	0.00%	0.00	0.00	c)
RU000A0JXU14	5.2500 % RUSSIA 5 1/4 06/23/47 REGS	200	0	0	200 USD	0.00%	0.00	0.00	c)
US00254ENB47	0.5000 % SEK 0 1/2 08/26/25	200	0	0	200 USD	93.54%	164'740.34	0.02	a)
US003865AB88	6.5000 % TAQAUH 6 1/2 10/27/36 144A	100	100	0	200 USD	111.93%	197'126.97	0.02	a)
US00828EEE59	0.8750 % AFDB 0 7/8 03/23/26 GDIF	0	80	0	80 USD	92.56%	65'205.78	0.01	a)
US00828EEP07	4.3750 % AFDB 4 3/8 11/03/27 GMTN	0	100	0	100 USD	99.65%	87'744.17	0.01	a)
US00828EEY14	4.6250 % AFDB 4 5/8 01/04/27	0	100	0	100 USD	100.19%	88'219.66	0.01	a)
US00946AAD63	2.5000 % HKAA 2 1/2 01/12/32 144A	200	0	0	200 USD	85.44%	150'475.43	0.01	a)
US013051EA13	3.3000 % ALTA 3.3 03/15/28	90	0	0	90 USD	95.24%	75'473.26	0.01	a)
US013051EF00	2.9500 % ALTA 2.95 01/23/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US013051EM50	1.3000 % ALTA 1.3 07/22/30	100	0	0	100 USD	82.04%	72'241.20	0.01	a)
US045167CY77	2.1250 % ASIA 2 1/8 03/19/25 GMTN	50	0	0	50 USD	96.99%	42'701.83	0.00	a)
US045167DN04	2.0000 % ASIA 2 04/24/26 GMTN	50	0	0	50 USD	94.58%	41'641.21	0.00	a)
US045167DR18	1.7500 % ASIA 1 3/4 08/14/26 GMTN	60	0	0	60 USD	93.49%	49'391.46	0.00	a)
US045167DU47	2.6250 % ASIA 2 5/8 01/12/27 GMTN	50	0	0	50 USD	94.95%	41'802.79	0.00	a)
US045167EG44	2.7500 % ASIA 2 3/4 01/19/28 GMTN	130	0	0	130 USD	93.97%	107'565.43	0.01	a)
US045167EJ82	3.1250 % ASIA 3 1/8 09/26/28 GMTN	100	0	0	100 USD	94.78%	83'460.29	0.01	a)
US045167EL39	2.6250 % ASIA 2 5/8 01/30/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167EP43	1.7500 % ASIA 1 3/4 09/19/29 GMTN	100	0	0	100 USD	87.08%	76'673.89	0.01	a)
US045167EQ26	1.5000 % ASIA 1 1/2 10/18/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167EU38	0.6250 % ASIA 0 5/8 04/29/25	200	0	0	200 USD	95.09%	167'466.52	0.02	a)
US045167EY59	0.7500 % ASIA 0 3/4 10/08/30 GMTN	100	0	0	100 USD	79.24%	69'778.30	0.01	a)
US045167EZ25	0.5000 % ASIA 0 1/2 02/04/26 GMTN	200	0	0	200 USD	92.32%	162'577.71	0.01	a)
US045167FP34	3.1250 % ASIA 3 1/8 08/20/27 GMTN	0	80	0	80 USD	95.69%	67'407.16	0.01	a)
US045167FV02	4.0000 % ASIA 4 01/12/33 GMTN	0	100	0	100 USD	97.00%	85'414.23	0.01	a)
US045167FW84	3.7500 % ASIA 3 3/4 04/25/28 GMTN	0	50	0	50 USD	97.42%	42'891.15	0.00	a)
US045167FZ16	4.5000 % ASIA 4 1/2 08/25/28 GMTN	0	50	0	50 USD	100.46%	44'229.59	0.00	a)
US045167GA55	4.1250 % ASIA 4 1/8 01/12/27 GMTN	0	100	0	100 USD	98.93%	87'109.29	0.01	a)
US04517PBU57	4.6250 % ASIA 4 5/8 06/13/25 GMTN	0	100	0	100 USD	99.54%	87'649.07	0.01	a)
US04522KAA43	2.2500 % AIIB 2 1/4 05/16/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04522KAD81	0.5000 % AIIB 0 1/2 01/27/26	150	0	0	150 USD	92.28%	121'887.05	0.01	a)
US04522KAE64	0.5000 % AIIB 0 1/2 10/30/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04522KAH95	3.7500 % AIIB 3 3/4 09/14/27	0	50	0	50 USD	97.40%	42'884.11	0.00	a)
US04522KAL08	4.1250 % AIIB 4 1/8 01/18/29	0	100	0	100 USD	98.76%	86'960.48	0.01	a)
US06120TAA60	5.0000 % BCHINA 5 11/13/24 REGS	200	0	0	200 USD	99.53%	175'277.00	0.02	a)
US06418BAA61	1.1880 % BNS 1.188 10/13/26 144A	250	0	0	250 USD	90.89%	200'080.77	0.02	a)
US09681MAB46	3.8750 % BOCAVI 3 7/8 04/27/26 REGS	200	0	0	200 USD	96.80%	170'469.20	0.02	a)
US110709AJ18	4.8000 % BRCOL 4.8 11/15/28	0	60	0	60 USD	101.16%	53'446.92	0.00	a)
US11070TAK43	2.2500 % BRCOL 2 1/4 06/02/26	100	0	0	100 USD	94.76%	83'442.68	0.01	a)
US11070TAM09	4.2000 % BRCOL 4.2 07/06/33	0	70	0	70 USD	96.63%	59'563.75	0.01	a)
US125094AQ51	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 144A	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US125094BE13	4.2500 % CADEPO 4 1/4 07/25/28 144A	0	250	0	250 USD	98.43%	216'681.34	0.02	a)
US12591DAC56	4.2500 % CNOOC 4 1/4 04/30/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12634MAB63	3.5000 % CNOOC 3 1/2 05/05/25	200	0	0	200 USD	97.96%	172'522.64	0.02	a)
US12802D2A30	0.3750 % CADES 0 3/8 09/23/25 144A	200	0	0	200 USD	93.25%	164'226.10	0.02	a)
US12802D2C95	1.3750 % CADES 1 3/8 01/20/31 144A	200	0	0	200 USD	81.42%	143'385.24	0.01	a)
US12802D2D78	0.6250 % CADES 0 5/8 02/18/26 144A	200	0	0	200 USD	92.26%	162'482.61	0.01	a)
US12802D2E51	0.3750 % CADES 0 3/8 05/27/24 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12802D2P09	4.2500 % CADES 4 1/4 01/24/27 144A	0	200	0	200 USD	99.12%	174'565.52	0.02	a)
US13063A5E03	7.5000 % 13063A5E0	200	0	0	200 USD	117.69%	207'257.46	0.02	a)
US13063A5G50	7.5500 % 13063A5G5	250	0	0	250 USD	121.51%	267'479.31	0.02	a)
US13063BJC72	7.6000 % 13063BJC7	150	0	0	150 USD	123.71%	163'404.02	0.01	a)
US135087K787	1.6250 % CANADA 1 5/8 01/22/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	0	100	0	100 USD	97.50%	85'851.86	0.01	a)
US13607GRX42	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 144A	200	0	0	200 USD	91.58%	161'278.02	0.01	a)
US168863BP27	3.6250 % CHILE 3 5/8 10/30/42	150	0	0	150 USD	77.70%	102'621.50	0.01	a)
US168863CF36	3.2400 % CHILE 3.24 02/06/28	200	0	0	200 USD	93.61%	164'849.53	0.02	a)
US20271AAL17	5.0710 % CBAAU 5.071 09/14/28 144A	0	250	0	250 USD	100.69%	221'647.64	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	0	70	0	70 USD	98.75%	60'865.55	0.01	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	0	50	0	50 USD	102.20%	44'995.22	0.00	a)
US222213AS92	2.5000 % COE 2 1/2 02/27/24	40	0	40	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US222213BB58	3.6250 % COE 3 5/8 01/26/28	80	0	0	80 USD	97.06%	68'374.36	0.01	a)
US22411VAP31	0.3750 % CPPIBC 0 3/8 07/29/25 144A	250	0	0	250 USD	93.72%	206'306.26	0.02	a)
US23330JAA97	6.8500 % DPWDU 6.85 07/02/37 144A	100	0	0	100 USD	108.17%	95'247.33	0.01	a)
US25159MBB28	1.2500 % DBJJP 1 1/4 01/28/31 144A	200	0	0	200 USD	79.85%	140'620.31	0.01	a)
US25159MBK27	5.1250 % DBJJP 5 1/8 09/01/26 144A	0	200	0	200 USD	100.52%	177'018.73	0.02	a)
US268317AE47	5.6000 % EDF 5.6 01/27/40 144A	100	0	0	100 USD	96.84%	85'274.22	0.01	a)
US268317AS33	3.6250 % EDF 3 5/8 10/13/25 144A	100	0	0	100 USD	97.50%	85'850.10	0.01	a)
US28504DAD57	6.9000 % EDF 6.9 05/23/53 144A	0	200	0	200 USD	109.10%	192'127.20	0.02	a)
US29446MAB81	3.6250 % EQNR 3 5/8 09/10/28	100	0	0	100 USD	95.64%	84'213.16	0.01	a)
US29446MAG78	3.6250 % EQNR 3 5/8 04/06/40	50	0	0	50 USD	82.49%	36'319.61	0.00	a)
US29446MAH51	3.7000 % EQNR 3.7 04/06/50	70	0	0	70 USD	77.90%	48'013.31	0.00	a)
US29874QEG55	0.5000 % EBRD 0 1/2 05/19/25	150	0	0	150 USD	94.72%	125'107.22	0.01	a)
US29874QEX88	4.3750 % EBRD 4 3/8 03/09/28 GMTN	0	50	0	50 USD	99.74%	43'911.27	0.00	a)
US298785DV50	4.8750 % EIB 4 7/8 02/15/36	40	0	0	40 USD	103.68%	36'519.23	0.00	a)
US298785GS94	1.8750 % EIB 1 7/8 02/10/25	50	0	0	50 USD	97.07%	42'736.61	0.00	a)
US298785HD17	2.1250 % EIB 2 1/8 04/13/26	50	0	0	50 USD	94.98%	41'816.88	0.00	a)
US298785HM16	2.3750 % EIB 2 3/8 05/24/27	150	0	0	150 USD	93.81%	123'907.91	0.01	a)
US298785HV15	2.6250 % EIB 2 5/8 03/15/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785HX70	2.2500 % EIB 2 1/4 06/24/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JB33	1.6250 % EIB 1 5/8 03/14/25	100	0	0	100 USD	96.58%	85'041.76	0.01	a)
US298785JD98	0.6250 % EIB 0 5/8 07/25/25	100	0	0	100 USD	94.30%	83'033.22	0.01	a)
US298785JH03	0.7500 % EIB 0 3/4 09/23/30	100	0	0	100 USD	79.72%	70'198.33	0.01	a)
US298785JJ68	0.6250 % EIB 0 5/8 10/21/27	50	0	0	50 USD	87.31%	38'442.17	0.00	a)
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	200	0	0	200 USD	91.67%	161'447.08	0.01	a)
US298785JL15	1.2500 % EIB 1 1/4 02/14/31	60	0	0	60 USD	81.74%	43'184.11	0.00	a)
US298785JN70	1.6250 % EIB 1 5/8 05/13/31	50	0	0	50 USD	83.48%	36'755.92	0.00	a)
US298785JP29	0.7500 % EIB 0 3/4 10/26/26	0	50	0	50 USD	90.66%	39'916.65	0.00	a)
US298785JR84	1.7500 % EIB 1 3/4 03/15/29	0	100	0	100 USD	88.33%	77'774.58	0.01	a)
US298785JU14	3.8750 % EIB 3 7/8 03/15/28	0	50	0	50 USD	98.02%	43'155.32	0.00	a)
US298785JW79	3.6250 % EIB 3 5/8 07/15/30	0	100	0	100 USD	95.92%	84'462.36	0.01	a)
US298785JY36	4.5000 % EIB 4 1/2 10/16/28	0	80	0	80 USD	100.55%	70'834.26	0.01	a)
US298785JZ01	4.0000 % EIB 4 02/15/29	0	100	0	100 USD	98.38%	86'630.27	0.01	a)
US302154BN89	3.2500 % EIBKOR 3 1/4 08/12/26	200	0	0	200 USD	96.06%	169'169.50	0.02	a)
US302154BT59	2.8750 % EIBKOR 2 7/8 01/21/25	200	0	0	200 USD	97.96%	172'515.59	0.02	a)
US302154DN61	2.1250 % EIBKOR 2 1/8 01/18/32	0	200	0	200 USD	82.13%	144'644.43	0.01	a)
US30216BHH87	2.6250 % EDC 2 5/8 02/21/24	70	0	70	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BJR42	3.0000 % EDC 3 05/25/27	50	50	0	100 USD	95.51%	84'098.69	0.01	a)
US30216BJU70	3.3750 % EDC 3 3/8 08/26/25	50	0	0	50 USD	97.86%	43'085.31	0.00	a)
US30216BJW37	3.8750 % EDC 3 7/8 02/14/28	0	70	0	70 USD	97.91%	60'352.72	0.01	a)
US30216BKB70	4.3750 % EDC 4 3/8 06/29/26	0	50	0	50 USD	99.40%	43'764.66	0.00	a)
US3130A1XJ24	2.8750 % FHLB 2 7/8 06/14/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130A2VE38	3.0000 % FHLB 3 09/11/26 0000	200	0	0	200 USD	96.21%	169'437.19	0.02	a)
US3130A3GE85	2.7500 % FHLB 2 3/4 12/13/24	200	0	0	200 USD	98.16%	172'873.10	0.02	a)
US3130AEB254	3.2500 % FHLB 3 1/4 06/09/28	50	0	0	50 USD	95.79%	42'175.26	0.00	a)
US3130AFFX04	3.2500 % FHLB 3 1/4 11/16/28	100	0	0	100 USD	95.74%	84'302.10	0.01	a)
US3130AGWK72	1.5000 % FHLB 1 1/2 08/15/24	100	0	0	100 USD	98.27%	86'527.25	0.01	a)
US3130AJHU68	0.5000 % FHLB 0 1/2 04/14/25	150	0	0	150 USD	95.20%	125'745.18	0.01	a)
US3130AK5E22	0.3750 % FHLB 0 3/8 09/04/25	100	0	0	100 USD	93.61%	82'424.76	0.01	a)
US3130AQF408	1.0000 % FHLB 1 12/20/24 0002	150	0	0	150 USD	96.68%	127'692.08	0.01	a)
US3130AQF655	1.2500 % FHLB 1 1/4 12/21/26	150	0	0	150 USD	91.56%	120'937.38	0.01	a)
US3130ATT312	4.5000 % FHLB 4 1/2 10/03/24	100	0	0	100 USD	99.56%	87'669.32	0.01	a)
US3130AXU635	4.6250 % FHLB 4 5/8 11/17/26	0	100	0	100 USD	100.44%	88'443.32	0.01	a)
US3130AYPN01	4.1250 % FHLB 4 1/8 01/15/27	0	100	0	100 USD	99.16%	87'315.34	0.01	a)
US313381FD22	2.5000 % FHLB 2 1/2 12/10/27	100	0	0	100 USD	93.35%	82'197.58	0.01	a)
US3133EMRZ77	0.2500 % FFCB 0 1/4 02/26/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3133EN5N62	4.0000 % FFCB 4 01/06/28	200	0	0	200 USD	98.42%	173'323.94	0.02	a)
US3133ENEJ55	0.8750 % FFCB 0 7/8 11/18/24	250	0	0	250 USD	96.93%	213'385.88	0.02	a)
US3133EPCF00	4.5000 % FFCB 4 1/2 03/02/26	0	100	0	100 USD	99.63%	87'732.72	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US3133EPNG63	4.3750 % FFCB 4 3/8 06/23/26	0	100	0	100 USD	99.37%	87'497.61	0.01	a)
US3133EPQC23	4.6250 % FFCB 4 5/8 07/17/26	0	100	0	100 USD	99.90%	87'967.83	0.01	a)
US3133EPS896	5.9400 % FFCB 5.94 01/02/36	0	100	0	100 USD	99.75%	87'833.10	0.01	a)
US3133EPW849	3.8750 % FFCB 3 7/8 01/18/29	0	100	0	100 USD	97.81%	86'123.07	0.01	a)
US3133EPX912	4.1250 % FFCB 4 1/8 01/25/27	0	100	0	100 USD	99.00%	87'173.57	0.01	a)
US3133XGAY07	5.5000 % FHLB 5 1/2 07/15/36	50	0	0	50 USD	109.27%	48'109.73	0.00	a)
US3134A2HG69	0.0000 % FHLMC 0 12/11/25	0	100	0	100 USD	91.90%	80'919.02	0.01	a)
US3134A3U467	6.7500 % FHLMC 6 3/4 09/15/29 GDIF	40	0	0	40 USD	111.73%	39'353.89	0.00	a)
US3134A4AA29	6.7500 % FHLMC 6 3/4 03/15/31	100	0	0	100 USD	114.18%	100'544.72	0.01	a)
US3134A4KX12	6.2500 % FHLMC 6 1/4 07/15/32	100	0	0	100 USD	113.34%	99'804.18	0.01	a)
US3134H1HH98	5.8500 % FHLMC 5.85 10/30/25	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31359MEB54	6.2100 % FNMA 6.21 08/06/38	50	0	0	50 USD	116.46%	51'276.19	0.00	a)
US31359MEU36	6.2500 % FNMA 6 1/4 05/15/29	40	0	0	40 USD	108.90%	38'357.81	0.00	a)
US31359MFP32	7.2500 % FNMA 7 1/4 05/15/30	100	0	0	100 USD	115.69%	101'868.19	0.01	a)
US31359MGK36	6.6250 % FNMA 6 5/8 11/15/30	40	0	0	40 USD	112.88%	39'760.00	0.00	a)
US3135G04Z35	0.5000 % FNMA 0 1/2 06/17/25	100	0	0	100 USD	94.63%	83'324.69	0.01	a)
US3135G05Q27	0.8750 % FNMA 0 7/8 08/05/30	100	0	0	100 USD	80.61%	70'979.37	0.01	a)
US3135G05X77	0.3750 % FNMA 0 3/8 08/25/25	0	100	0	100 USD	93.69%	82'496.09	0.01	a)
US3135G05Y50	0.7500 % FNMA 0 3/4 10/08/27	50	0	0	50 USD	87.94%	38'716.90	0.00	a)
US3135G06G36	0.5000 % FNMA 0 1/2 11/07/25	130	0	0	130 USD	93.23%	106'718.35	0.01	a)
US3135G0K368	2.1250 % FNMA 2 1/8 04/24/26	70	0	0	70 USD	95.09%	58'608.97	0.01	a)
US3135G0Q225	1.8750 % FNMA 1 7/8 09/24/26	100	0	0	100 USD	93.71%	82'518.98	0.01	a)
US3135G0V753	1.7500 % FNMA 1 3/4 07/02/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3135G0X247	1.6250 % FNMA 1 5/8 01/07/25	100	0	0	100 USD	97.13%	85'527.82	0.01	a)
US3135G0ZR78	2.6250 % FNMA 2 5/8 09/06/24	100	0	0	100 USD	98.68%	86'891.79	0.01	a)
US31364FDC23	6.0300 % FNMA 6.03 10/08/27 MTN	50	0	0	50 USD	105.21%	46'322.21	0.00	a)
US3137EAEPO9	1.5000 % FHLMC 1 1/2 02/12/25	250	0	0	250 USD	96.66%	212'773.90	0.02	a)
US3137EAEU93	0.3750 % FHLMC 0 3/8 07/21/25 USD	200	0	0	200 USD	94.10%	165'726.55	0.02	a)
US3137EAEX33	0.3750 % FHLMC 0 3/8 09/23/25	200	0	0	200 USD	93.43%	164'543.10	0.02	a)
US38611TDL89	3.2360 % 38611TDL8	100	0	0	100 USD	72.47%	63'812.49	0.01	a)
US427028AB18	0.7500 % CANADA 0 3/4 05/19/26	0	70	0	70 USD	91.93%	56'662.42	0.01	a)
US43858AAH32	4.6250 % HKINTL 4 5/8 01/11/33 144A	0	200	0	200 USD	101.41%	178'598.43	0.02	a)
US445545AF36	7.6250 % REPHUN 7 5/8 03/29/41	40	50	0	90 USD	114.56%	90'787.43	0.01	a)
US445545AL04	5.3750 % REPHUN 5 3/8 03/25/24	14	0	0	14 USD	99.91%	12'315.99	0.00	a)
US452151LF83	5.1000 % 452151LF8	300	0	0	300 USD	98.51%	260'222.60	0.02	a)
US4581X0CE61	4.3750 % IADB 4 3/8 01/24/44	30	0	0	30 USD	94.99%	25'093.30	0.00	a)
US4581X0CF37	3.0000 % IADB 3 02/21/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0CM87	2.1250 % IADB 2 1/8 01/15/25	200	0	100	100 USD	97.46%	85'814.00	0.01	a)
US4581X0CU04	2.0000 % IADB 2 06/02/26 GMTN	155	0	0	155 USD	94.35%	128'776.56	0.01	a)
US4581X0CY26	2.3750 % IADB 2 3/8 07/07/27	100	0	0	100 USD	93.50%	82'333.19	0.01	a)
US4581X0DC96	3.1250 % IADB 3 1/8 09/18/28	100	0	0	100 USD	94.77%	83'445.32	0.01	a)
US4581X0DL95	0.8750 % IADB 0 7/8 04/03/25	50	0	0	50 USD	95.59%	42'083.69	0.00	a)
US4581X0DN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	100	0	0	100 USD	94.33%	83'062.28	0.01	a)
US4581X0DQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	50	0	0	50 USD	87.54%	38'542.99	0.00	a)
US4581X0DS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	100	0	0	100 USD	80.80%	71'148.44	0.01	a)
US4581X0DV77	0.8750 % IADB 0 7/8 04/20/26 GMTN	50	0	0	50 USD	92.40%	40'680.53	0.00	a)
US4581X0EB05	1.5000 % IADB 1 1/2 01/13/27	0	70	0	70 USD	91.98%	56'693.24	0.01	a)
US4581X0EF19	3.5000 % IADB 3 1/2 09/14/29	0	50	0	50 USD	95.60%	42'089.41	0.00	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	0	60	0	60 USD	93.06%	49'167.97	0.00	a)
US4581X0EN43	4.1250 % IADB 4 1/8 02/15/29	0	80	0	80 USD	98.92%	69'685.32	0.01	a)
US45828Q2A46	2.6250 % IDBINV 2 5/8 04/22/25	0	60	0	60 USD	97.20%	51'354.73	0.00	a)
US45828Q2B29	4.1250 % IDBINV 4 1/8 02/15/28	0	70	0	70 USD	98.23%	60'549.35	0.01	a)
US459058DX80	2.5000 % IBRD 2 1/2 11/25/24 GDIF	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058EP48	2.5000 % IBRD 2 1/2 07/29/25 GDIF	80	0	0	80 USD	96.75%	68'151.05	0.01	a)
US459058FT50	1.8750 % IBRD 1 7/8 10/27/26 GDIF	50	0	0	50 USD	93.38%	41'114.20	0.00	a)
US459058GE72	2.5000 % IBRD 2 1/2 11/22/27 GDIF	80	0	0	80 USD	93.37%	65'775.68	0.01	a)
US459058GQ03	2.5000 % IBRD 2 1/2 03/19/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058HJ50	1.7500 % IBRD 1 3/4 10/23/29 GDIF	100	0	0	100 USD	86.87%	76'490.74	0.01	a)
US459058HT33	1.6250 % IBRD 1 5/8 01/15/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058JA24	0.7500 % IBRD 0 3/4 03/11/25	80	0	0	80 USD	95.72%	67'429.00	0.01	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	100	0	0	100 USD	95.19%	83'816.03	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US459058JC89	0.8750 % IBRD 0 7/8 05/14/30	80	0	0	80 USD	80.88%	56'976.52	0.01	a)
US459058JE46	0.3750 % IBRD 0 3/8 07/28/25	100	0	0	100 USD	93.90%	82'684.53	0.01	a)
US459058JG93	0.7500 % IBRD 0 3/4 08/26/30	120	0	0	120 USD	79.50%	84'007.64	0.01	a)
US459058JL88	0.5000 % IBRD 0 1/2 10/28/25	150	0	0	150 USD	93.20%	123'098.25	0.01	a)
US459058JN45	0.7500 % IBRD 0 3/4 11/24/27	100	0	0	100 USD	87.40%	76'960.95	0.01	a)
US459058JR58	1.2500 % IBRD 1 1/4 02/10/31	150	0	0	150 USD	81.31%	107'393.64	0.01	a)
US459058JW44	1.3750 % IBRD 1 3/8 04/20/28 GDIF	100	0	0	100 USD	88.54%	77'961.26	0.01	a)
US459058JX27	0.8750 % IBRD 0 7/8 07/15/26	0	80	0	80 USD	91.74%	64'625.33	0.01	a)
US459058KL69	3.6250 % IBRD 3 5/8 09/21/29	0	100	0	100 USD	96.30%	84'799.61	0.01	a)
US459058KQ56	3.8750 % IBRD 3 7/8 02/14/30	0	90	0	90 USD	97.28%	77'089.95	0.01	a)
US459058KT95	3.5000 % IBRD 3 1/2 07/12/28	0	100	0	100 USD	96.46%	84'937.85	0.01	a)
US459058KW25	4.6250 % IBRD 4 5/8 08/01/28	0	90	0	90 USD	100.95%	80'004.75	0.01	a)
US459058LA95	4.0000 % IBRD 4 01/10/31	0	100	0	100 USD	97.58%	85'922.31	0.01	a)
US459058CAA27	4.7500 % IBRD 4 3/4 02/15/35 GMTN	50	0	0	50 USD	101.37%	44'630.68	0.00	a)
US45906M3D11	2.5000 % IBRD 2 1/2 03/29/32	0	90	0	90 USD	87.33%	69'206.21	0.01	a)
US45939E2A70	4.8750 % IDAWBG 4 7/8 11/01/28 144A	0	100	0	100 USD	101.87%	89'701.63	0.01	a)
US45939EAD22	0.8750 % IDAWBG 0 7/8 04/28/26 144A	50	0	0	50 USD	92.30%	40'637.82	0.00	a)
US45950KDD90	4.5000 % IFC 4 1/2 07/13/28 GMTN	0	100	0	100 USD	100.44%	88'439.80	0.01	a)
US45950VHX73	2.1250 % IFC 2 1/8 04/07/26 GMTN	140	0	0	140 USD	94.99%	117'102.06	0.01	a)
US46513EJX13	5.5000 % AID 5 1/2 04/26/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46513YJH27	3.2500 % ISRAEL 3 1/4 01/17/28	200	0	0	200 USD	92.45%	162'820.74	0.01	a)
US465410BX58	2.3750 % ITALY 2 3/8 10/17/24	200	0	0	200 USD	98.03%	172'644.16	0.02	a)
US465410BZ07	4.0000 % ITALY 4 10/17/49	200	0	0	200 USD	71.35%	125'656.25	0.01	a)
US471048AZ14	2.2500 % JBIC 2 1/4 11/04/26 DTC	200	0	0	200 USD	93.65%	164'928.78	0.02	a)
US471048BT45	3.2500 % JBIC 3 1/4 07/20/28	200	0	0	200 USD	94.43%	166'295.39	0.02	a)
US471048BY30	2.5000 % JBIC 2 1/2 05/23/24 DTC	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US471048CJ53	0.6250 % JBIC 0 5/8 07/15/25	0	200	0	200 USD	94.04%	165'617.37	0.02	a)
US471048CM82	1.8750 % JBIC 1 7/8 04/15/31	0	200	0	200 USD	83.00%	146'162.49	0.01	a)
US47109LAG95	4.0000 % JICA 4 05/23/28	0	200	0	200 USD	97.01%	170'837.27	0.02	a)
US50046PBW41	1.3750 % KOMINS 1 3/8 05/08/24 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50046PCA12	4.7500 % KOMINS 4 3/4 10/22/25 144A	0	200	0	200 USD	99.69%	175'565.82	0.02	a)
US50048MBZ23	2.1250 % KBN 2 1/8 04/23/25 144A	200	0	0	200 USD	96.62%	170'152.20	0.02	a)
US50048MDJ62	4.0000 % KBN 4 01/19/28 144A	0	200	0	200 USD	98.00%	172'578.99	0.02	a)
US500630CJ53	3.0000 % KDB 3 01/13/26	300	0	0	300 USD	96.49%	254'895.45	0.02	a)
US50064FAM68	2.7500 % KOREA 2 3/4 01/19/27	200	0	0	200 USD	94.76%	166'878.31	0.02	a)
US50065XAG97	3.2500 % KOROIL 3 1/4 07/10/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50065XAP96	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/28 REGS	0	200	0	200 USD	99.06%	174'454.57	0.02	a)
US50066CAN92	3.1250 % KORGAS 3 1/8 07/20/27 REGS	200	0	0	200 USD	93.92%	165'397.23	0.02	a)
US500769BR40	0.0000 % KFW 0 04/18/36	0	20	0	20 USD	57.93%	10'201.52	0.00	a)
US500769CH58	0.0000 % KFW 0 06/29/37	50	0	0	50 USD	54.72%	24'090.53	0.00	a)
US500769GK42	2.5000 % KFW 2 1/2 11/20/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769GQ12	2.0000 % KFW 2 05/02/25	50	0	0	50 USD	96.60%	42'528.36	0.00	a)
US500769HS68	2.8750 % KFW 2 7/8 04/03/28	100	0	0	100 USD	94.20%	82'945.17	0.01	a)
US500769JC98	1.3750 % KFW 1 3/8 08/05/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JD71	1.7500 % KFW 1 3/4 09/14/29	50	0	0	50 USD	87.28%	38'425.88	0.00	a)
US500769JF20	0.3750 % KFW 0 3/8 07/18/25	120	0	0	120 USD	94.00%	99'321.81	0.01	a)
US500769JG03	0.7500 % KFW 0 3/4 09/30/30	50	0	0	50 USD	79.64%	35'064.82	0.00	a)
US500769JJ42	0.6250 % KFW 0 5/8 01/22/26	200	0	0	200 USD	92.69%	163'232.84	0.01	a)
US500769JM70	0.2500 % KFW 0 1/4 03/08/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JQ84	1.0000 % KFW 1 10/01/26	0	50	0	50 USD	91.50%	40'286.04	0.00	a)
US500769JR67	1.2500 % KFW 1 1/4 01/31/25	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JT24	3.0000 % KFW 3 05/20/27	0	90	0	90 USD	95.54%	75'712.59	0.01	a)
US500769JU96	3.1250 % KFW 3 1/8 06/10/25	0	50	0	50 USD	97.74%	43'031.16	0.00	a)
US500769JW52	3.7500 % KFW 3 3/4 02/15/28	0	70	0	70 USD	97.49%	60'089.52	0.01	a)
US500769JY19	4.1250 % KFW 4 1/8 07/15/33	0	70	0	70 USD	97.75%	60'249.17	0.01	a)
US500769JZ83	4.6250 % KFW 4 5/8 08/07/26	0	70	0	70 USD	100.05%	61'671.17	0.01	a)
US500769KA14	5.1250 % KFW 5 1/8 09/29/25	0	50	0	50 USD	100.39%	44'198.77	0.00	a)
US500769KB96	4.7500 % KFW 4 3/4 10/29/30	0	50	0	50 USD	102.14%	44'967.49	0.00	a)
US500769KC79	4.0000 % KFW 4 03/15/29	0	100	0	100 USD	98.29%	86'549.26	0.01	a)
US515110BP87	2.3750 % RENTEN 2 3/8 06/10/25	50	0	0	50 USD	96.76%	42'601.45	0.00	a)
US515110BR44	1.7500 % RENTEN 1 3/4 07/27/26 GMTN	50	0	0	50 USD	93.53%	41'176.72	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US515110BT00	2.5000 % RENTEN 2 1/2 11/15/27 37	100	0	0	100 USD	93.30%	82'158.84	0.01	a)
US515110CE22	5.0000 % RENTEN 5 10/24/33 MTN	0	50	0	50 USD	104.50%	46'008.74	0.00	a)
US563469UL77	2.1250 % MP 2 1/8 06/22/26	50	0	0	50 USD	94.31%	41'520.13	0.00	a)
US59259NZH96	7.3360 % 59259NZH9	0	150	0	150 USD	120.47%	159'121.90	0.01	a)
US626207YF57	6.6370 % 626207YF5	98	0	1	97 USD	112.24%	95'867.69	0.01	a)
US62878U2B73	2.6250 % NBNAUS 2 5/8 05/05/31 144A	0	200	0	200 USD	84.79%	149'316.62	0.01	a)
US62944BBG86	2.3750 % BNG 2 3/8 03/16/26 144A	50	0	0	50 USD	95.42%	42'008.84	0.00	a)
US63983TBB08	2.3750 % NEDWBK 2 3/8 03/24/26 144A	200	0	0	200 USD	95.39%	167'989.57	0.02	a)
US646139X831	7.1020 % 646139X83	120	0	0	120 USD	116.89%	123'508.44	0.01	a)
US65562QBP90	0.3750 % NIB 0 3/8 09/11/25	0	200	0	200 USD	93.48%	164'631.15	0.02	a)
US676167CB35	0.3750 % OKB 0 3/8 09/17/25	0	80	0	80 USD	93.34%	65'755.25	0.01	a)
US676167CC18	0.5000 % OKB 0 1/2 02/02/26 GMTN	100	0	0	100 USD	92.26%	81'241.30	0.01	a)
US676167CJ60	4.2500 % OKB 4 1/4 03/01/28	0	50	0	50 USD	99.13%	43'645.78	0.00	a)
US683234AS74	0.6250 % ONT 0 5/8 01/21/26	200	0	0	200 USD	92.49%	162'889.42	0.01	a)
US68323ACT97	3.2000 % ONT 3.2 05/16/24	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68323AFF66	2.3000 % ONT 2.3 06/15/26	100	0	0	100 USD	94.74%	83'419.78	0.01	a)
US68323AFJ88	1.8000 % ONT 1.8 10/14/31	0	100	0	100 USD	82.41%	72'566.13	0.01	a)
US68329AAL26	3.0000 % ONTFT 3 04/13/27 144A	250	0	0	250 USD	95.10%	209'355.17	0.02	a)
US69370RAA59	6.4500 % PERTU 6.45 05/30/44 REGS	200	0	0	200 USD	104.62%	184'242.76	0.02	a)
US698299AW45	6.7000 % PANAMA 6.7 01/26/36	100	0	0	100 USD	94.56%	83'262.17	0.01	a)
US698299BF03	3.8750 % PANAMA 3 7/8 03/17/28	200	0	0	200 USD	90.54%	159'453.52	0.01	a)
US698299BH68	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/16/50	0	200	0	200 USD	65.09%	114'622.95	0.01	a)
US698299BM53	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/01/56	200	0	0	200 USD	63.05%	111'030.31	0.01	a)
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	70	0	0	70 USD	122.76%	75'665.57	0.01	a)
US715638BM30	5.6250 % PERU 5 5/8 11/18/50	70	0	0	70 USD	98.97%	61'003.62	0.01	a)
US715638BU55	4.1250 % PERU 4 1/8 08/25/27	50	0	0	50 USD	96.69%	42'571.07	0.00	a)
US715638DA73	2.8440 % PERU 2.844 06/20/30	0	40	0	40 USD	87.15%	30'695.27	0.00	a)
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	80	0	0	80 USD	85.06%	59'921.78	0.01	a)
US715638DQ26	2.7800 % PERU 2.78 12/01/60	30	0	0	30 USD	57.34%	15'148.28	0.00	a)
US715638DR09	3.2300 % PERU 3.23 07/28/2121	50	0	0	50 USD	57.16%	25'167.44	0.00	a)
US715638DU38	3.0000 % PERU 3 01/15/34	0	50	0	50 USD	81.30%	35'793.92	0.00	a)
US71567RAD89	4.3250 % INDOIS 4.325 05/28/25 REGS	200	0	0	200 USD	99.31%	174'900.12	0.02	a)
US71567RAM88	4.4500 % INDOIS 4.45 02/20/29 REGS	200	0	0	200 USD	97.56%	171'809.39	0.02	a)
US71568QAF46	6.1500 % PLNIJ 6.15 05/21/48 REGS	0	200	0	200 USD	97.82%	172'263.76	0.02	a)
US71568QAJ67	3.8750 % PLNIJ 3 7/8 07/17/29 REGS	200	0	0	200 USD	92.46%	162'838.35	0.01	a)
US718286BB24	7.7500 % PHILIP 7 3/4 01/14/31	100	0	0	100 USD	115.23%	101'462.25	0.01	a)
US718286BG11	6.3750 % PHILIP 6 3/8 10/23/34	100	0	0	100 USD	109.80%	96'683.51	0.01	a)
US718286BW60	5.0000 % PHILIP 5 01/13/37	0	200	0	200 USD	98.43%	173'339.79	0.02	a)
US718286CB15	3.7000 % PHILIP 3.7 02/02/42	200	0	0	200 USD	81.25%	143'089.38	0.01	a)
US718286CC97	3.0000 % PHILIP 3 02/01/28	200	0	0	200 USD	92.87%	163'549.83	0.01	a)
US731011AU68	3.2500 % POLAND 3 1/4 04/06/26	60	0	0	60 USD	97.27%	51'389.07	0.00	a)
US731011AV42	4.8750 % POLAND 4 7/8 10/04/33	0	70	0	70 USD	97.91%	60'349.64	0.01	a)
US731011AW25	5.5000 % POLAND 5 1/2 04/04/53	0	40	0	40 USD	99.88%	35'179.03	0.00	a)
US73358WEK62	4.9260 % 73358WEK6	100	0	0	100 USD	97.23%	85'613.23	0.01	a)
US73358WJA36	4.4580 % 73358WJA3	100	0	0	100 USD	89.15%	78'496.63	0.01	a)
US74727PAE16	9.7500 % QATAR 9 3/4 06/15/30 144A	100	0	0	100 USD	127.94%	112'656.69	0.01	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	50	0	0	50 USD	114.14%	50'252.55	0.00	a)
US748148RZ80	1.5000 % Q 1 1/2 02/11/25 QX	100	0	0	100 USD	96.59%	85'054.97	0.01	a)
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	50	0	0	50 USD	98.47%	43'352.56	0.00	a)
US748149AJ05	2.5000 % Q 2 1/2 04/20/26	100	0	0	100 USD	95.46%	84'060.83	0.01	a)
US748149AN17	2.7500 % Q 2 3/4 04/12/27	90	0	0	90 USD	94.62%	74'986.67	0.01	a)
US760942AS16	7.6250 % URUGUA 7 5/8 03/21/36	100	0	0	100 USD	120.11%	105'764.62	0.01	a)
US760942BA98	5.1000 % URUGUA 5.1 06/18/50	80	0	0	80 USD	96.02%	67'640.33	0.01	a)
US760942BD38	4.9750 % URUGUA 4.975 04/20/55	40	0	0	40 USD	93.12%	32'797.67	0.00	a)
US77586TAE64	6.1250 % ROMANI 6 1/8 01/22/44 REGS	30	0	0	30 USD	95.14%	25'132.66	0.00	a)
US780082AJ23	2.6000 % RY 2.6 03/24/27 144A	200	0	0	200 USD	93.54%	164'733.29	0.02	a)
US857524AC63	4.0000 % POLAND 4 01/22/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US857524AE20	5.7500 % POLAND 5 3/4 11/16/32	0	50	0	50 USD	104.26%	45'903.95	0.00	a)
US85771PAN24	3.7000 % EQNR 3.7 03/01/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87031CAN39	4.8750 % SEK 4 7/8 10/04/30 GMTN	0	200	0	200 USD	101.50%	178'753.41	0.02	a)
US87973PBA12	1.6250 % TEMASE 1 5/8 08/02/31 144A	250	0	0	250 USD	81.58%	179'594.78	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US880591CS97	5.8800 % TVA 5.88 04/01/36	70	0	0	70 USD	111.30%	68'601.18	0.01	a)
US880591DZ22	5.3750 % TVA 5 3/8 04/01/56	65	0	0	65 USD	106.48%	60'946.34	0.01	a)
US880591EH15	5.2500 % TVA 5 1/4 09/15/39	50	50	0	100 USD	103.59%	91'212.65	0.01	a)
US880591EU26	2.8750 % TVA 2 7/8 02/01/27 A	100	0	0	100 USD	95.50%	84'094.29	0.01	a)
US88258MAA36	5.1020 % TNG23 2023-1 A1	0	100	0	100 USD	100.92%	88'865.76	0.01	a)
US882667AZ12	3.9220 % 882667AZ1	100	0	0	100 USD	81.23%	71'523.73	0.01	a)
US891160TB95	3.3010 % TD 3.301 04/20/27 144A	200	0	0	200 USD	95.39%	167'984.28	0.02	a)
US891160TC78	3.8150 % TD 3.815 07/25/25 144A	0	200	0	200 USD	98.13%	172'809.70	0.02	a)
US91086QAS75	6.7500 % MEX 6 3/4 09/27/34 MTNA	100	0	0	100 USD	105.45%	92'856.64	0.01	a)
US91086QAV05	6.0500 % MEX 6.05 01/11/40	70	0	0	70 USD	97.91%	60'351.49	0.01	a)
US91086QAZ19	5.7500 % MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN	100	0	0	100 USD	86.46%	76'131.47	0.01	a)
US91086QBF46	4.6000 % MEX 4.6 01/23/46	250	0	0	250 USD	79.78%	175'632.30	0.02	a)
US91087BAC46	4.1500 % MEX 4.15 03/28/27	200	0	0	200 USD	97.50%	171'709.01	0.02	a)
US91087BAF76	4.5000 % MEX 4 1/2 04/22/29	0	200	0	200 USD	96.17%	169'372.03	0.02	a)
US91087BAL45	5.0000 % MEX 5 04/27/51	0	200	0	200 USD	83.22%	146'564.03	0.01	a)
US91087BAM28	2.6590 % MEX 2.659 05/24/31	200	0	0	200 USD	82.80%	145'817.32	0.01	a)
US91087BAN01	3.7710 % MEX 3.771 05/24/61	200	0	0	200 USD	64.28%	113'196.46	0.01	a)
US912810EV62	6.8750 % T 6 7/8 08/15/25	50	0	0	50 USD	102.90%	45'303.61	0.00	a)
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	130	0	0	130 USD	102.41%	117'225.97	0.01	a)
US912810EX29	6.7500 % T 6 3/4 08/15/26	100	0	0	100 USD	104.90%	92'368.32	0.01	a)
US912810EY02	6.5000 % T 6 1/2 11/15/26	100	0	0	100 USD	104.95%	92'416.48	0.01	a)
US912810EZ76	6.6250 % T 6 5/8 02/15/27	100	0	0	100 USD	105.93%	93'276.39	0.01	a)
US912810FA17	6.3750 % T 6 3/8 08/15/27	50	0	0	50 USD	106.12%	46'720.74	0.00	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	200	0	0	200 USD	105.85%	186'415.19	0.02	a)
US912810FE39	5.5000 % T 5 1/2 08/15/28	100	0	0	100 USD	104.83%	92'306.41	0.01	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	105	0	0	105 USD	103.93%	96'091.05	0.01	a)
US912810FG86	5.2500 % T 5 1/4 02/15/29	200	0	0	200 USD	103.95%	183'058.09	0.02	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	200	0	0	200 USD	110.45%	194'519.00	0.02	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	170	0	0	170 USD	106.92%	160'055.10	0.01	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	150	0	0	150 USD	103.44%	136'622.84	0.01	a)
US912810PT97	4.7500 % T 4 3/4 02/15/37	102	0	0	102 USD	105.55%	94'798.08	0.01	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	115	0	0	115 USD	107.88%	109'237.73	0.01	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	150	0	0	150 USD	101.13%	133'568.43	0.01	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	135	0	0	135 USD	102.22%	121'511.77	0.01	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	125	0	0	125 USD	90.92%	100'076.57	0.01	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	200	100	0	300 USD	98.89%	261'234.42	0.02	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	190	100	0	290 USD	101.56%	259'349.49	0.02	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	270	0	0	270 USD	99.95%	237'637.06	0.02	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	145	100	0	245 USD	102.69%	221'532.63	0.02	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	250	0	0	250 USD	99.59%	219'243.20	0.02	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	215	0	0	215 USD	93.48%	176'982.99	0.02	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	240	0	0	240 USD	97.72%	206'510.99	0.02	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	290	0	0	290 USD	103.69%	264'775.88	0.02	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	165	0	0	165 USD	98.89%	143'678.93	0.01	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	280	0	0	280 USD	91.20%	224'864.95	0.02	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	190	0	0	190 USD	83.23%	139'254.85	0.01	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	320	0	0	320 USD	82.92%	233'653.94	0.02	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	200	0	0	200 USD	81.03%	142'704.13	0.01	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	230	0	0	230 USD	77.78%	157'527.65	0.01	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	325	100	0	425 USD	77.50%	290'031.16	0.03	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	415	0	0	415 USD	82.08%	299'936.66	0.03	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	555	100	0	655 USD	78.70%	453'928.34	0.04	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	375	100	0	475 USD	88.16%	368'723.44	0.03	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	310	120	0	430 USD	89.67%	339'530.45	0.03	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	400	150	0	550 USD	87.91%	425'732.17	0.04	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	340	100	0	440 USD	84.55%	327'570.10	0.03	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	430	100	0	530 USD	81.14%	378'676.40	0.03	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	440	0	0	440 USD	79.33%	307'350.47	0.03	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	620	0	0	620 USD	72.48%	395'721.93	0.04	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	211	100	0	311 USD	79.09%	216'599.06	0.02	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	400	0	0	400 USD	77.22%	271'979.88	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	355	0	0	355 USD	78.80%	246'315.29	0.02	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	280	300	0	580 USD	71.77%	366'520.69	0.03	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	430	100	0	530 USD	71.58%	334'049.02	0.03	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	503	220	0	723 USD	67.92%	432'416.23	0.04	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	250	0	0	250 USD	76.52%	168'439.58	0.02	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	480	100	0	580 USD	78.14%	399'079.02	0.04	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	335	100	0	435 USD	78.03%	298'890.32	0.03	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	650	0	0	650 USD	74.34%	425'512.03	0.04	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	480	200	0	680 USD	74.20%	444'309.02	0.04	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	590	200	0	790 USD	77.72%	540'638.44	0.05	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	690	100	0	790 USD	79.47%	552'812.05	0.05	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	750	150	0	900 USD	77.59%	614'926.59	0.06	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	810	200	0	1'010 USD	83.06%	738'720.91	0.07	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	810	100	0	910 USD	77.50%	621'007.89	0.06	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	770	200	0	970 USD	75.61%	645'805.00	0.06	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	680	150	0	830 USD	66.25%	484'192.43	0.04	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	660	130	0	790 USD	68.03%	473'248.85	0.04	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	860	200	0	1'060 USD	62.28%	581'322.60	0.05	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	920	220	0	1'140 USD	50.80%	509'912.75	0.05	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	1'210	150	0	1'360 USD	52.50%	628'712.70	0.06	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	800	300	0	1'100 USD	61.09%	591'757.12	0.05	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	650	270	0	920 USD	61.70%	499'860.72	0.05	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	1'200	250	0	1'450 USD	56.17%	717'201.10	0.07	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	850	250	0	1'100 USD	63.48%	614'912.83	0.06	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	1'230	250	0	1'480 USD	59.89%	780'503.01	0.07	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	1'090	260	0	1'350 USD	68.91%	819'117.88	0.07	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	1'200	250	0	1'450 USD	67.52%	862'037.81	0.08	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	1'050	150	0	1'200 USD	73.02%	771'526.90	0.07	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	1'260	200	0	1'460 USD	61.63%	792'252.85	0.07	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	1'180	440	0	1'620 USD	66.61%	950'176.74	0.09	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	1'120	260	0	1'380 USD	59.63%	724'538.55	0.07	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	1'000	400	0	1'400 USD	69.22%	853'307.98	0.08	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	1'120	100	0	1'220 USD	65.45%	703'143.94	0.06	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	850	200	0	1'050 USD	73.52%	679'708.93	0.06	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	980	200	0	1'180 USD	75.34%	782'858.48	0.07	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	700	100	0	800 USD	84.13%	592'610.15	0.05	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	970	100	0	1'070 USD	77.36%	728'871.13	0.07	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	700	0	0	700 USD	85.52%	527'105.49	0.05	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	930	300	0	1'230 USD	93.67%	1'014'538.06	0.09	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	640	400	0	1'040 USD	93.38%	855'102.11	0.08	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	0	1'160	0	1'160 USD	87.47%	893'439.05	0.08	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	0	690	0	690 USD	91.59%	556'504.85	0.05	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	1'160	0	1'160 USD	87.55%	894'237.05	0.08	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	0	800	0	800 USD	91.45%	644'232.39	0.06	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	0	1'350	0	1'350 USD	95.81%	1'138'963.91	0.10	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	0	800	0	800 USD	97.94%	689'910.93	0.06	a)
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	0	870	0	870 USD	106.47%	815'634.21	0.07	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	0	590	0	590 USD	102.94%	534'785.53	0.05	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	805	350	0	1'155 USD	93.04%	946'240.07	0.09	a)
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	678	0	678	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	790	150	0	940 USD	93.23%	771'652.11	0.07	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	470	0	0	470 USD	98.07%	405'856.16	0.04	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	620	200	0	820 USD	92.85%	670'435.64	0.06	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	370	0	0	370 USD	97.76%	318'511.10	0.03	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	650	0	0	650 USD	97.66%	558'987.59	0.05	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	730	0	0	730 USD	97.69%	627'936.72	0.06	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	1'275	0	0	1'275 USD	94.27%	1'058'409.06	0.10	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	580	0	0	580 USD	97.78%	499'387.42	0.05	a)
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	260	0	0	260 USD	97.51%	223'237.31	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	520	0	0	520 USD	97.64%	447'100.64	0.04	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	950	280	0	1'230 USD	94.49%	1'023'422.68	0.09	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	600	0	0	600 USD	97.54%	515'348.76	0.05	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	1'070	200	0	1'270 USD	94.25%	1'053'996.34	0.10	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	450	0	0	450 USD	97.02%	384'421.99	0.04	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	520	0	0	520 USD	97.30%	445'508.77	0.04	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	800	0	0	800 USD	97.20%	684'737.69	0.06	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	1'100	100	0	1'200 USD	95.08%	1'004'652.52	0.09	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	490	0	0	490 USD	96.93%	418'222.04	0.04	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	350	100	0	450 USD	96.42%	382'053.79	0.03	a)
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	1'170	0	1'170	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	430	100	0	530 USD	96.31%	449'482.25	0.04	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	800	300	0	1'100 USD	92.66%	897'473.07	0.08	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	550	0	0	550 USD	95.98%	464'835.81	0.04	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	1'060	0	1'060	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	450	0	0	450 USD	95.38%	377'921.05	0.03	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	310	100	0	410 USD	95.48%	344'722.94	0.03	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	897	150	0	1'047 USD	91.23%	841'122.41	0.08	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	520	0	0	520 USD	94.84%	434'276.25	0.04	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	450	0	0	450 USD	94.22%	373'339.45	0.03	a)
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	1'540	0	1'540	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	1'215	0	1'215	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	1'093	0	1'093	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	1'500	0	0	1'500 USD	97.11%	1'282'593.32	0.12	a)
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	930	0	0	930 USD	96.05%	786'570.89	0.07	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	1'310	0	0	1'310 USD	95.95%	1'106'838.97	0.10	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	840	250	0	1'090 USD	94.41%	906'110.72	0.08	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	795	200	0	995 USD	93.86%	822'346.33	0.08	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	755	250	0	1'005 USD	93.76%	829'712.34	0.08	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	760	200	0	960 USD	94.02%	794'806.44	0.07	a)
US912828W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	690	0	690	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	2'050	0	2'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	1'439	0	1'439	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	925	200	0	1'125 USD	94.01%	931'259.03	0.09	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	790	100	0	890 USD	96.73%	758'097.14	0.07	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	520	0	0	520 USD	97.31%	445'562.43	0.04	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	350	0	0	350 USD	97.32%	299'921.86	0.03	a)
US912828Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	450	0	0	450 USD	94.00%	372'472.65	0.03	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	850	100	0	950 USD	87.49%	731'891.84	0.07	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	350	100	0	450 USD	92.66%	367'179.03	0.03	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	300	0	0	300 USD	93.13%	246'024.30	0.02	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	450	0	0	450 USD	92.89%	368'076.78	0.03	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	670	0	0	670 USD	87.70%	517'374.73	0.05	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	450	0	0	450 USD	92.76%	367'550.52	0.03	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	400	100	0	500 USD	92.92%	409'111.79	0.04	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	650	0	0	650 USD	97.27%	556'707.10	0.05	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	800	0	0	800 USD	96.69%	681'132.94	0.06	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	1'250	230	0	1'480 USD	92.06%	1'199'771.39	0.11	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	980	250	0	1'230 USD	85.56%	926'707.33	0.08	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	260	0	0	260 USD	90.85%	207'998.29	0.02	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	520	0	0	520 USD	96.21%	440'536.42	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	300	100	0	400 USD	89.23%	314'301.32	0.03	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	500	210	0	710 USD	95.30%	595'787.01	0.05	a)
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	700	0	0	700 USD	94.86%	584'723.04	0.05	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	520	100	0	620 USD	88.59%	483'626.96	0.04	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	1'300	250	0	1'550 USD	80.29%	1'095'827.29	0.10	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	640	0	0	640 USD	88.32%	497'730.89	0.05	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	500	250	0	750 USD	94.38%	623'315.90	0.06	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	600	230	0	830 USD	88.07%	643'667.61	0.06	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	500	240	0	740 USD	94.10%	613'172.37	0.06	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	750	100	0	850 USD	93.77%	701'834.46	0.06	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	600	260	0	860 USD	87.41%	661'903.93	0.06	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	1'750	350	0	2'100 USD	79.62%	1'472'245.21	0.13	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	520	250	0	770 USD	87.56%	593'694.33	0.05	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	500	310	0	810 USD	93.46%	666'633.80	0.06	a)
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	750	250	0	1'000 USD	86.91%	765'252.98	0.07	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	1'050	0	0	1'050 USD	93.16%	861'337.84	0.08	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	1'100	0	0	1'100 USD	92.86%	899'440.55	0.08	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	750	200	0	950 USD	87.05%	728'232.06	0.07	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	1'820	440	0	2'260 USD	80.50%	1'601'984.62	0.15	a)
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	840	250	0	1'090 USD	87.24%	837'350.08	0.08	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	800	250	0	1'050 USD	92.77%	857'762.33	0.08	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	970	150	0	1'120 USD	86.98%	857'853.82	0.08	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	1'000	150	0	1'150 USD	92.51%	936'803.73	0.09	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	1'000	250	0	1'250 USD	92.21%	1'014'911.27	0.09	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	1'000	250	0	1'250 USD	87.20%	959'833.89	0.09	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	1'730	450	0	2'180 USD	81.55%	1'565'373.00	0.14	a)
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	1'150	100	0	1'250 USD	88.34%	972'388.62	0.09	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	900	370	0	1'270 USD	92.19%	1'030'931.43	0.09	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	880	220	0	1'100 USD	88.61%	858'274.84	0.08	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	850	370	0	1'220 USD	92.46%	993'281.04	0.09	a)
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	950	200	0	1'150 USD	92.17%	933'362.36	0.09	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	990	200	0	1'190 USD	88.41%	926'368.87	0.08	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	1'730	2'210	1'900	2'040 USD	83.83%	1'505'823.05	0.14	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	1'050	250	0	1'300 USD	88.21%	1'009'763.84	0.09	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	800	320	0	1'120 USD	91.93%	906'625.30	0.08	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	1'000	200	0	1'200 USD	88.02%	930'108.46	0.09	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	900	100	0	1'000 USD	92.02%	810'243.59	0.07	a)
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	900	200	0	1'100 USD	91.17%	883'095.34	0.08	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	1'000	200	0	1'200 USD	86.85%	917'725.73	0.08	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	1'890	450	0	2'340 USD	80.97%	1'668'350.57	0.15	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	1'080	200	0	1'280 USD	87.13%	982'077.42	0.09	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	970	200	0	1'170 USD	91.22%	939'775.25	0.09	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	950	240	0	1'190 USD	87.45%	916'299.64	0.08	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	1'020	100	0	1'120 USD	91.33%	900'692.58	0.08	a)
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	960	200	0	1'160 USD	87.80%	896'870.45	0.08	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	870	300	0	1'170 USD	91.66%	944'282.56	0.09	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	1'850	370	0	2'220 USD	81.19%	1'587'070.30	0.15	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	990	250	0	1'240 USD	91.78%	1'002'142.95	0.09	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	900	250	0	1'150 USD	88.16%	892'777.95	0.08	a)
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	800	0	0	800 USD	96.81%	681'985.98	0.06	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	900	240	0	1'140 USD	87.44%	877'721.23	0.08	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	850	240	0	1'090 USD	91.63%	879'416.29	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	300	0	0	300 USD	96.64%	255'280.39	0.02	a)
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	880	200	0	1'080 USD	88.90%	845'418.81	0.08	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	1'760	410	0	2'170 USD	83.98%	1'604'767.98	0.15	a)
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	1'020	0	0	1'020 USD	89.30%	802'099.88	0.07	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	950	100	0	1'050 USD	92.91%	859'062.52	0.08	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	850	0	0	850 USD	96.68%	723'645.28	0.07	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	650	240	0	890 USD	91.39%	716'218.73	0.07	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	850	250	0	1'100 USD	94.56%	915'937.10	0.08	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	770	0	0	770 USD	97.43%	660'622.66	0.06	a)
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	650	280	0	930 USD	93.58%	766'322.02	0.07	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	820	200	0	1'020 USD	95.15%	854'586.16	0.08	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	1'720	360	0	2'080 USD	90.41%	1'655'830.25	0.15	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	750	0	0	750 USD	97.46%	643'618.41	0.06	a)
US91282CE561	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	750	100	0	850 USD	92.90%	695'314.61	0.06	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	820	100	0	920 USD	94.67%	766'942.54	0.07	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	720	0	0	720 USD	97.48%	617'997.51	0.06	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	670	100	0	770 USD	95.13%	645'022.83	0.06	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	800	100	0	900 USD	96.52%	764'943.42	0.07	a)
US91282CEX56	3.0000 % T 3 06/30/24	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	750	0	0	750 USD	97.55%	644'237.55	0.06	a)
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	860	150	0	1'010 USD	94.86%	843'637.07	0.08	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	630	200	0	830 USD	92.13%	673'301.55	0.06	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	800	0	0	800 USD	97.63%	687'737.07	0.06	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	1'660	250	0	1'910 USD	89.28%	1'501'577.15	0.14	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	730	100	0	830 USD	95.97%	701'393.85	0.06	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	590	100	0	690 USD	94.38%	573'450.62	0.05	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	300	430	0	730 USD	98.08%	630'447.66	0.06	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	700	0	0	700 USD	98.02%	604'153.61	0.06	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	700	200	0	900 USD	99.20%	786'117.90	0.07	a)
US91282CFN65	4.2500 % T 4 1/4 09/30/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	0	400	0	400 USD	99.19%	349'371.97	0.03	a)
US91282CFQ96	4.3750 % T 4 3/8 10/31/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	450	350	0	800 USD	98.59%	694'533.81	0.06	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	750	100	0	850 USD	99.19%	742'386.20	0.07	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	1'630	440	0	2'070 USD	98.95%	1'803'656.71	0.17	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	100	600	0	700 USD	99.61%	613'977.25	0.06	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	400	0	0	400 USD	99.46%	350'335.08	0.03	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	600	100	0	700 USD	97.98%	603'912.84	0.06	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	750	100	0	850 USD	98.34%	736'071.01	0.07	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	650	200	0	850 USD	98.78%	739'345.56	0.07	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	580	100	0	680 USD	97.95%	586'471.07	0.05	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	760	100	0	860 USD	98.34%	744'671.51	0.07	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	670	100	0	770 USD	98.58%	668'382.85	0.06	a)
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	600	250	0	850 USD	97.00%	726'013.48	0.07	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	470	250	0	720 USD	95.96%	608'388.51	0.06	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	0	700	0	700 USD	98.81%	609'065.43	0.06	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	0	1'960	0	1'960 USD	94.34%	1'628'258.03	0.15	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	0	100	0	100 USD	99.58%	87'683.52	0.01	a)
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	0	820	0	820 USD	98.77%	713'194.60	0.07	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	0	700	0	700 USD	98.52%	607'283.70	0.06	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	0	800	0	800 USD	100.00%	704'440.00	0.06	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	0	710	0	710 USD	96.52%	603'455.36	0.06	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	0	950	0	950 USD	97.39%	814'694.49	0.07	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	0	780	0	780 USD	98.80%	678'619.25	0.06	a)
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	0	750	0	750 USD	98.30%	649'216.45	0.06	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	0	850	0	850 USD	98.78%	739'345.56	0.07	a)
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	0	650	0	650 USD	95.81%	548'390.03	0.05	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	0	900	0	900 USD	96.91%	767'977.19	0.07	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	0	880	0	880 USD	98.03%	759'628.47	0.07	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	2'010	0	2'010 USD	93.31%	1'651'543.07	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	0	750	0	750 USD	99.18%	654'969.26	0.06	a)
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	0	820	0	820 USD	97.35%	702'927.94	0.06	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	0	700	0	700 USD	97.10%	598'519.47	0.05	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	0	830	0	830 USD	99.07%	724'061.82	0.07	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	0	790	0	790 USD	97.08%	675'308.93	0.06	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	0	900	0	900 USD	98.80%	782'960.30	0.07	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	0	760	0	760 USD	99.68%	667'074.42	0.06	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	0	900	0	900 USD	99.92%	791'875.87	0.07	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	0	750	0	750 USD	99.88%	659'586.98	0.06	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	0	930	0	930 USD	99.30%	813'153.53	0.07	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	0	650	0	650 USD	98.45%	563'503.84	0.05	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	0	2'100	0	2'100 USD	97.02%	1'793'969.28	0.16	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	0	800	0	800 USD	99.67%	702'128.56	0.06	a)
US91282CHV63	5.0000 % T 5 08/31/25	0	570	0	570 USD	100.27%	503'246.71	0.05	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	0	750	0	750 USD	99.11%	654'530.70	0.06	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	0	900	0	900 USD	100.32%	795'033.47	0.07	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	0	980	0	980 USD	100.29%	865'433.44	0.08	a)
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	0	750	0	750 USD	101.97%	673'414.38	0.06	a)
US91282CJA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	0	1'000	0	1'000 USD	101.35%	892'451.19	0.08	a)
US91282CJB81	5.0000 % T 5 09/30/25	0	970	0	970 USD	100.32%	856'869.40	0.08	a)
US91282CJC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	0	950	0	950 USD	100.34%	839'332.70	0.08	a)
US91282CJE21	5.0000 % T 5 10/31/25	0	1'000	0	1'000 USD	100.39%	883'989.65	0.08	a)
US91282CJF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	0	1'050	0	1'050 USD	102.45%	947'186.32	0.09	a)
US91282CJG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	0	700	0	700 USD	103.41%	637'380.61	0.06	a)
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	0	1'650	0	1'650 USD	101.91%	1'480'603.55	0.14	a)
US91282CJL80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	0	1'000	0	1'000 USD	100.38%	883'852.06	0.08	a)
US91282CJL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	0	1'100	0	1'100 USD	100.25%	970'988.68	0.09	a)
US91282CJM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	0	800	0	800 USD	100.56%	708'402.48	0.06	a)
US91282CJN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	0	1'200	0	1'200 USD	100.43%	1'061'200.34	0.10	a)
US91282CJP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	0	1'000	0	1'000 USD	99.80%	878'830.18	0.08	a)
US91282CJQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	0	800	0	800 USD	96.92%	682'756.46	0.06	a)
US91282CJR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	0	1'150	0	1'150 USD	97.73%	989'690.04	0.09	a)
US91282CJS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	0	1'100	0	1'100 USD	99.23%	961'113.45	0.09	a)
US91324PEC23	1.1500 % UNH 1.15 05/15/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEE88	3.0500 % UNH 3.05 05/15/41	0	80	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEF53	3.2500 % UNH 3 1/4 05/15/51	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91412HFG39	3.3490 % 91412HFG3	100	0	0	100 USD	94.13%	82'883.27	0.01	a)
US917288BK78	4.3750 % URUGUA 4 3/8 01/23/31	70	0	0	70 USD	97.37%	60'017.41	0.01	a)
US96122WAM29	3.1500 % WSTP 3.15 01/16/24 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96122WAQ33	4.1840 % WSTP 4.184 05/22/28 144A	0	200	0	200 USD	97.42%	171'562.84	0.02	a)
USD4546MLM53	3.8750 % KFW 3 7/8 06/15/28	0	30	0	30 USD	97.84%	25'846.17	0.00	a)
USG21184AB52	4.2500 % CCAMCL 4 1/4 04/23/25 REGS	200	0	0	200 USD	98.24%	173'013.99	0.02	a)
USG8201JAC56	3.2500 % SINOPE 3 1/4 04/28/25 REGS	200	0	0	200 USD	97.61%	171'895.69	0.02	a)
USG8201NAH55	3.2500 % SINOPE 3 1/4 09/13/27 REGS	200	0	0	200 USD	94.67%	166'728.62	0.02	a)
USG8201NAJ12	4.0000 % SINOPE 4 09/13/47 REGS	200	0	0	200 USD	84.37%	148'576.96	0.01	a)
USP30179BK34	3.8750 % CFELEC 3 7/8 07/26/33 REGS	200	0	0	200 USD	81.82%	144'100.25	0.01	a)
USP3143NAY06	3.6250 % CDEL 3 5/8 08/01/27 REGS	200	0	0	200 USD	94.06%	165'643.78	0.02	a)
USP3143NBF08	3.7000 % CDEL 3.7 01/30/50 REGS	200	0	0	200 USD	67.47%	118'826.70	0.01	a)
USP6629MAD40	5.5000 % MEXCAT 5 1/2 07/31/47 REGS	200	0	0	200 USD	83.07%	146'289.29	0.01	a)
USY20721AE96	8.5000 % INDON 8 1/2 10/12/35 REGS	100	0	0	100 USD	127.14%	111'954.01	0.01	a)
USY20721AL30	7.7500 % INDON 7 3/4 01/17/38 REGS	100	0	0	100 USD	122.59%	107'944.86	0.01	a)
USY20721BE87	4.6250 % INDON 4 5/8 04/15/43 REGS	200	0	0	200 USD	91.84%	161'741.19	0.01	a)
USY20721BK48	6.7500 % INDON 6 3/4 01/15/44 REGS	200	0	0	200 USD	115.69%	203'746.94	0.02	a)
USY20721BN86	4.7500 % INDON 4 3/4 01/08/26 REGS	200	0	0	200 USD	99.65%	175'498.90	0.02	a)
USY20721BR90	5.2500 % INDON 5 1/4 01/08/47 REGS	200	0	0	200 USD	98.54%	173'535.27	0.02	a)
USY39656AC06	4.8750 % ICBCAS 4 7/8 09/21/25 REGS	200	0	0	200 USD	98.79%	173'972.02	0.02	a)
USY4899GCB78	3.2500 % KOHNPW 3 1/4 06/15/25 REGS	200	0	0	200 USD	97.36%	171'465.98	0.02	a)
USY54788AA57	3.1790 % MALAYS 3.179 04/27/26 REGS	250	0	0	250 USD	96.72%	212'908.18	0.02	a)
USY68856AQ98	4.5000 % PETMK 4 1/2 03/18/45 REGS	200	0	0	200 USD	88.27%	155'452.30	0.01	a)
USY6886MAE04	2.4800 % PETMK 2.48 01/28/32 REGS	200	0	0	200 USD	82.87%	145'945.88	0.01	a)
USY7140WAC20	6.5300 % IDASAL 6.53 11/15/28 REGS	200	0	0	200 USD	103.40%	182'092.46	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X51085735899	5.1250 % PORTUG 5 1/8 10/15/24 REGS	150	0	0	150 USD	99.74%	131'732.48	0.01	a)
X51111314651	2.8750 % DBJP 2 7/8 09/19/24 GMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51252209249	3.8750 % BCHINA 3 7/8 06/30/25 EMTN	200	0	0	200 USD	98.17%	172'883.66	0.02	a)
X51263054519	5.1250 % KAZAKS 5 1/8 07/21/25 REGS	200	0	0	200 USD	100.77%	177'457.24	0.02	a)
X51265180643	4.7500 % MINMET 4 3/4 07/30/25	200	0	0	200 USD	98.96%	174'280.22	0.02	a)
X51308339420	4.0000 % CHGDN 4 11/05/25	200	0	0	200 USD	97.67%	172'004.88	0.02	a)
X51405782159	3.2500 % QATAR 3 1/4 06/02/26 REGS	200	0	0	200 USD	96.59%	170'099.37	0.02	a)
X51457499645	3.7500 % ONGCIN 3 3/4 07/27/26	200	0	0	200 USD	96.08%	169'197.68	0.02	a)
X51508675417	3.2500 % KSA 3 1/4 10/26/26 REGS	250	0	0	250 USD	95.45%	210'110.24	0.02	a)
X51582346968	3.5000 % KUWIB 3 1/2 03/20/27 REGS	0	200	0	200 USD	96.75%	170'393.47	0.02	a)
X51694217495	3.6250 % KSA 3 5/8 03/04/28 REGS	250	0	0	250 USD	95.17%	209'511.46	0.02	a)
X51694218469	4.6250 % KSA 4 5/8 10/04/47 REGS	250	0	0	250 USD	84.65%	186'339.79	0.02	a)
X51696892295	3.1250 % ADGB 3 1/8 10/11/27 REGS	250	0	0	250 USD	94.74%	208'567.07	0.02	a)
X51696899035	4.1250 % ADGB 4 1/8 10/11/47 REGS	0	200	0	200 USD	83.39%	146'865.17	0.01	a)
X51788513734	5.1250 % HAOHUA 5 1/8 03/14/28	200	0	0	200 USD	99.00%	174'343.62	0.02	a)
X51807174559	5.1030 % QATAR 5.103 04/23/48 REGS	200	0	0	200 USD	96.35%	169'676.70	0.02	a)
X51807300105	5.3750 % KZOKZ 5 3/8 04/24/30 REGS	200	0	0	200 USD	97.06%	170'930.60	0.02	a)
X51811821211	4.7500 % CHIOLI 4 3/4 04/26/28	200	0	0	200 USD	96.90%	170'654.11	0.02	a)
X51837994794	5.1250 % ROMANI 5 1/8 06/15/48 REGS	30	0	0	30 USD	83.17%	21'969.55	0.00	a)
X51877838877	4.7230 % SECO 4.723 09/27/28	200	0	0	200 USD	98.99%	174'338.33	0.02	a)
X51891574441	3.5000 % CHINA 3 1/2 10/19/28	200	0	0	200 USD	96.89%	170'636.50	0.02	a)
X51904648570	4.5000 % MUBAUH 4 1/2 11/07/28 REGS	200	0	0	200 USD	98.15%	172'857.25	0.02	a)
X51936302865	4.3750 % KSA 4 3/8 04/16/29 REGS	200	0	0	200 USD	97.01%	170'851.36	0.02	a)
X51936302949	5.2500 % KSA 5 1/4 01/16/50 REGS	0	200	0	200 USD	92.23%	162'426.25	0.01	a)
X51936784161	4.2500 % CCB 4 1/4 02/27/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51964673351	3.8750 % ORIEAS 3 7/8 03/20/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51982113208	3.5000 % ARAMCO 3 1/2 04/16/29 REGS	200	0	0	200 USD	92.94%	163'667.83	0.01	a)
X51982116136	4.3750 % ARAMCO 4 3/8 04/16/49 REGS	200	0	0	200 USD	81.46%	143'457.44	0.01	a)
X52008801370	2.4400 % SUMIBK 2.44 06/18/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52031976678	2.0000 % LBANK 2 07/23/24 EMTN	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52035038731	1.8750 % NRWK 1 7/8 07/31/24 EMTN	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52046591413	2.3750 % STSP 2 3/8 08/28/29 EMTN	200	0	0	200 USD	88.43%	155'737.60	0.01	a)
X52053345646	2.3000 % YANTZE 2.3 10/16/24	200	0	0	200 USD	97.98%	172'556.10	0.02	a)
X52075924048	3.7000 % MUBAUH 3.7 11/07/49 REGS	200	0	0	200 USD	75.42%	132'823.92	0.01	a)
X52084425623	2.7500 % CHINA 2 3/4 12/03/39	200	0	0	200 USD	79.19%	139'456.23	0.01	a)
X52101346208	1.7500 % RENTEN 1 3/4 01/14/27 EMTN	100	0	0	100 USD	92.51%	81'455.28	0.01	a)
X52125308168	3.1250 % ADGB 3 1/8 04/16/30 REGS	200	0	0	200 USD	91.50%	161'137.13	0.01	a)
X52125308242	3.8750 % ADGB 3 7/8 04/16/50 REGS	200	0	0	200 USD	79.28%	139'627.05	0.01	a)
X52152902479	1.6250 % CHGRID 1 5/8 08/05/30 EMTN	200	0	0	200 USD	83.14%	146'424.90	0.01	a)
X52155352748	4.4000 % QATAR 4.4 04/16/50 REGS	200	0	0	200 USD	87.20%	153'560.88	0.01	a)
X52159975882	4.5000 % KSA 4 1/2 04/22/60 REGS	200	0	0	200 USD	80.79%	142'282.79	0.01	a)
X52167193015	3.8000 % ISRAEL 3.8 05/13/60	200	0	0	200 USD	68.38%	120'431.06	0.01	a)
X52179918037	2.0000 % CNPCC 2 06/23/30	200	0	0	200 USD	85.16%	149'975.28	0.01	a)
X52201851172	3.0000 % ROMANI 3 02/14/31 REGS	40	0	0	40 USD	83.06%	29'253.63	0.00	a)
X52201851685	4.0000 % ROMANI 4 02/14/51 REGS	40	0	0	40 USD	69.18%	24'365.88	0.00	a)
X52287744218	1.3750 % QNBK 1 3/8 01/26/26 EMTN	200	0	0	200 USD	92.45%	162'806.65	0.01	a)
X52311370337	0.8750 % NRWK 0 7/8 03/09/26 EMTN	160	0	0	160 USD	92.49%	130'307.31	0.01	a)
X52327851874	3.5000 % CHILE 3 1/2 04/15/53	0	200	0	200 USD	72.21%	127'167.27	0.01	a)
X52357494322	2.2500 % QPETRO 2 1/4 07/12/31 REGS	200	0	0	200 USD	83.15%	146'428.42	0.01	a)
X52357494751	3.3000 % QPETRO 3.3 07/12/51 REGS	0	200	0	200 USD	69.20%	121'871.64	0.01	a)
X52388586401	2.1250 % REPHUN 2 1/8 09/22/31 REGS	200	0	0	200 USD	78.17%	137'666.95	0.01	a)
X52397083820	2.8750 % UAE 2 7/8 10/19/41 REGS	200	0	0	200 USD	72.61%	127'868.19	0.01	a)
X52399836936	1.4350 % ISDB 1.435 10/21/26	200	0	0	200 USD	91.48%	161'110.71	0.01	a)
X52408477797	2.2500 % KSA 2 1/4 05/17/31 REGS	200	0	0	200 USD	83.13%	146'407.29	0.01	a)
X52431453336	2.8500 % CCB 2.85 01/21/32	0	200	0	200 USD	93.97%	165'481.76	0.02	a)
X52485248806	5.2500 % ROMANI 5 1/4 11/25/27 REGS	60	0	0	60 USD	98.06%	51'805.40	0.00	a)
X52571923007	7.1250 % ROMANI 7 1/8 01/17/33 REGS	70	0	0	70 USD	105.34%	64'928.76	0.01	a)
X52571924070	7.6250 % ROMANI 7 5/8 01/17/53 REGS	0	40	0	40 USD	109.13%	38'436.36	0.00	a)
X52576361195	4.5810 % FABUH 4.581 01/17/28 EMTN	200	0	0	200 USD	98.77%	173'945.61	0.02	a)
X52585988061	4.8750 % PIFSA 4 7/8 02/14/35	0	200	0	200 USD	94.69%	166'760.32	0.02	a)
X52589321020	4.5980 % ISDB 4.598 03/14/28	0	200	0	200 USD	99.64%	175'472.48	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2596437918	4.8750 % LBANK 4 7/8 03/09/26 EMTN	0	70	0	70 USD	100.06%	61'675.48	0.01	a)
XS2598333701	5.1250 % NEWDEV 5 1/8 04/26/26 EMTN	0	200	0	200 USD	99.34%	174'942.39	0.02	a)
XS2625209270	5.8750 % EBIUH 5 7/8 10/11/28 EMTN	0	200	0	200 USD	103.00%	181'391.54	0.02	a)
XS2626274463	4.5110 % KSA 4.511 05/22/33 REGS	0	200	0	200 USD	96.26%	169'527.01	0.02	a)
XS2747598444	4.7500 % KSA 4 3/4 01/16/30 REGS	0	200	0	200 USD	97.93%	172'471.57	0.02	a)
XS2755904526	5.0000 % PIFKSA 5 01/29/29	0	200	0	200 USD	98.54%	173'531.75	0.02	a)
XS2756954835	4.1250 % KFW 4 1/8 01/31/28 EMTN	0	50	0	50 USD	98.68%	43'444.14	0.00	a)
USD							231'853'158.80	21.22	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							128'299'553.45	11.74	
IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	29'386'930	8'610'000	2'010'000	35'986'930 USD	4.05	128'299'553.45	11.74	a)
USD							128'299'553.45	11.74	

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

							322'766'862.29	29.55	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							322'766'862.29	29.55	
CH0117052453	SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF	67'735	17'513	0	85'248 CHF	101.93	8'689'088.11	0.80	a)
CHF							8'689'088.11	0.80	
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	194'623	141'820	22'087	314'356 CNY	1'101.46	42'315'096.79	3.87	a)
CNY							42'315'096.79	3.87	
CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	345'218	92'744	14'287	423'675 EUR	118.99	48'037'800.40	4.40	a)
EUR							48'037'800.40	4.40	
CH0383288252	SWC (CH) INDEX BF JAPAN GOVT. ST	1'295	366	89	1'572 JPY	9'335'167.41	86'344'025.80	7.90	a)
JPY							86'344'025.80	7.90	
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	985'840	283'648	56'295	1'213'194 USD	128.60	137'380'851.19	12.58	a)
USD							137'380'851.19	12.58	
Derivative Finanzinstrumente							-0.01	0.00	

Devisentermingeschäfte

CHF/CNY	Verfall 06.07.2023	5'380'000	665'237		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.07.2023	680'000	407'323		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 06.07.2023	220'000	53'334		ILS/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.07.2023	91'000'000	564'614		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.07.2023	510'000	345'345		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 06.07.2023	260'000	172'655		SGD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.07.2023	440'000	500'394		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 06.07.2023	930'000	204'660		PLN/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 06.07.2023	730'000	61'141		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.07.2023	3'050'000	2'981'079		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.07.2023	4'600'000	4'122'566		USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.09.2023	134'189	140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 06.09.2023	132'838	1'600'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.09.2023	68'636	120'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.09.2023	247'272	280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 06.09.2023	120'119	990'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 06.09.2023	1'064'193	8'750'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.09.2023	4'668'016	5'280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 06.09.2023	1'144'429	189'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.09.2023	176'942	310'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.09.2023	1'509'600	1'580'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.10.2023	49'465	940'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.10.2023	111'638	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.10.2023	402'447	440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.10.2023	242'109	250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CZK/CHF	Verfall 05.04.2023	1'321'697	31'451'000		CHF/CZK	0.00	0.00
---------	--------------------	-----------	------------	--	---------	------	------

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NZD/CHF	Verfall 05.04.2023		1'447'009	2'501'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.04.2023		1'787'638	13'404'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.04.2023		25'136'363	36'636'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 05.04.2023		81'888'694	608'485'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.04.2023		2'037'568	2'935'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.04.2023		1'031'392	4'031'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.04.2023		3'448'068	38'440'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.04.2023		112'212'967	16'293'423'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.04.2023		35'082'046	31'012'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.04.2023		2'881'644	56'919'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.04.2023		727'142	8'042'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.04.2023		419'758'006	449'515'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.04.2023		13'136'895	20'837'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.04.2023		195'437'621	196'950'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 05.04.2023		2'914'790	110'250'000	CHF/THB		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 05.04.2023		1'443'988	6'878'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.04.2023		104'621	152'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.04.2023		1'946'000	1'947'820	EUR/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.04.2023		525'169	76'028'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.04.2023		7'087'000	967'305	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.04.2023		2'414'000	2'259'473	USD/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.04.2023		314'144	277'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.04.2023		252'785	407'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.04.2023		1'206'312	171'282'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.04.2023		3'187'919	3'446'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.04.2023		4'377'767	4'410'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 05.04.2023		827'837	6'153'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 05.04.2023		31'451'000	1'329'528	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.04.2023		450'547'000	411'521'971	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 05.04.2023		2'501'000	1'429'246	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.04.2023		21'244'000	12'996'229	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 05.04.2023		8'042'000	701'391	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 05.04.2023		6'878'000	1'458'198	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.04.2023		31'289'000	35'336'733	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 05.04.2023		36'788'000	24'828'773	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 05.04.2023		56'919'000	2'878'752	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.04.2023		607'551'000	80'813'396	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 05.04.2023		2'935'000	2'016'410	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.04.2023		16'540'733'000	113'533'276	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 05.04.2023		13'404'000	1'785'775	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.04.2023		199'414'000	197'892'471	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 05.04.2023		38'440'000	3'386'064	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 05.04.2023		4'031'000	1'022'588	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 05.04.2023		110'250'000	2'945'219	THB/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 05.04.2023		9'979'201	14'128'722'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 05.04.2023		14'128'722'000	9'893'176	KRW/CHF		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.05.2023		1'482'311	7'027'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 03.05.2023		1'347'051	32'017'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		424'109'524	465'799'000	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 03.05.2023		1'457'244	2'558'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.05.2023		13'370'818	21'903'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 03.05.2023		714'800	8'211'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2023		36'612'539	32'501'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.05.2023		25'251'938	37'519'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 03.05.2023		2'926'975	58'392'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.05.2023		2'081'636	3'037'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.05.2023		1'807'112	13'582'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023		202'967'762	204'840'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.05.2023		3'433'725	39'044'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 03.05.2023		1'024'682	4'050'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2023		1'090'400	966'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023		3'933'109	3'964'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		11'139'873	12'244'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.05.2023		610'883	903'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.05.2023		357'034	578'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 03.05.2023		4'050'000	991'148	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.05.2023		208'804'000	205'188'141	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 03.05.2023		32'017'000	1'339'783	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.05.2023		17'025'566'000	111'297'828	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.05.2023		38'422'000	25'209'904	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.05.2023		33'467'000	37'439'366	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.05.2023		22'481'000	13'223'369	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 03.05.2023		39'044'000	3'387'262	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 03.05.2023		58'392'000	2'879'917	MXN/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SGD Verfall 03.05.2023		3'037'000	2'025'791		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.05.2023		7'027'000	1'507'144		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.05.2023		639'910'000	82'260'431		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2023		13'582'000	1'790'603		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		2'558'000	1'405'979		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		478'043'000	425'470'221		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.05.2023		8'211'000	683'615		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		81'201'878	611'078'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 04.05.2023		3'004'321	112'705'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		3'819'490	28'832'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 04.05.2023		112'705'000	2'937'881		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 04.05.2023		10'075'743	14'420'394'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 04.05.2023		14'420'394'000	9'646'826		KRW/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		115'728'086	16'841'211'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		1'272'942	184'355'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 01.06.2023		2'049'734	3'081'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		3'081'000	2'078'997		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		4'068'000	995'444		ILS/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		992'633	4'068'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		203'529'431	207'501'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.06.2023		1'333'819	32'042'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		111'006'669	16'965'118'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		25'159'610	38'464'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		36'637'937	32'848'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		13'191'689	22'479'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		3'382'485	39'070'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		2'870'247	58'804'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2023		1'509'027	7'075'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		82'642'337	643'667'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		423'421'624	477'501'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2023		678'839	8'171'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		5'055'058	770'634'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		6'020'352	6'142'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		375'626	574'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		474'444	427'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		13'536'128	15'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		2'773'049	21'657'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2023		46'000'000	305'211		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2023		213'643'000	208'189'442		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.06.2023		39'038'000	26'249'151		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2023		22'479'000	13'296'576		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2023		7'075'000	1'519'777		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2023		665'324'000	85'349'759		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2023		17'689'752'000	115'766'336		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2023		39'070'000	3'281'372		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.06.2023		58'804'000	3'023'902		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		33'275'000	37'693'554		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2023		8'171'000	670'243		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.06.2023		32'042'000	1'313'158		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2023		492'691'000	450'427'966		USD/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.06.2023		10'496'895	15'722'911'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.06.2023		15'722'911'000	10'789'255		KRW/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.06.2023		1'780'042	13'524'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.06.2023		1'416'395	2'587'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.06.2023		2'913'261	112'083'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.06.2023		112'083'000	2'944'275		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.06.2023		2'587'000	1'416'874		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.06.2023		13'524'000	1'769'480		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 04.07.2023		32'225'000	1'323'771		CZK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		207'737'238	213'565'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		25'611'377	38'198'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		2'061'430	3'063'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		13'081'519	22'170'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.07.2023		1'517'556	7'103'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		85'833'898	669'829'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		473'089	696'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		115'794'984	17'673'335'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.07.2023		996'701	4'083'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		3'272'869	39'045'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2023		3'022'729	59'391'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.07.2023		2'920'398	111'446'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.07.2023		1'401'334	2'568'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		35'896'371	31'782'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.07.2023		668'133	8'163'000		CHF/NOK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		442'400'801	485'844'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2023		1'778'065	13'610'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		256'389	226'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		57'577	451'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		28'591	4'366'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		1'588'338	1'754'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		870'311	894'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		43'985	74'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		112'710	168'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.07.2023		269'798	10'311'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		354'423	4'195'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		2'264'105	349'318'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		181'028	295'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		2'892'248	3'202'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		1'575'697	12'478'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		761'983	669'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2023		270'775	5'189'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		3'986'725	4'081'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		75'000	85'766		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		2'492'000	311'647		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		2'656'000	2'384'304		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		240'000	235'061		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		1'598'000	1'433'882		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.07.2023		7'103'000	1'563'725		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.07.2023		4'083'000	984'236		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.07.2023		8'163'000	681'733		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2023		64'580'000	3'367'621		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.07.2023		13'610'000	1'784'217		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		680'266'000	83'651'630		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		18'027'019'000	111'582'741		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.07.2023		2'568'000	1'407'516		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.07.2023		43'240'000	3'581'829		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.07.2023		121'757'000	3'072'538		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		39'062'000	26'409'701		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.07.2023		3'063'000	2'024'909		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		486'546'000	435'281'081		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		32'602'000	37'081'189		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		22'539'000	13'422'673		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		218'300'000	213'077'391		EUR/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 06.07.2023		10'513'856	15'363'635'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 06.07.2023		15'363'635'000	10'440'799		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 07.07.2023		1'313'916	32'225'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		1'576'899	7'195'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		671'075	8'051'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2023		3'387'682	65'534'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		1'777'099	13'573'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		83'923'607	683'061'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		112'244'640	18'109'407'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.08.2023		1'392'761	2'549'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2023		3'558'161	43'027'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 04.08.2023		3'062'855	121'566'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		26'165'013	38'800'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2023		2'018'288	3'059'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		433'125'785	485'579'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 04.08.2023		1'337'479	32'696'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		36'930'051	32'558'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		212'201'462	217'739'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		13'202'563	22'217'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		287'766	46'314'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		526'156	779'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		3'659'719	3'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		1'146'343	9'278'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		457'075	403'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		8'695'591	9'732'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		206'604	943'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		321'592	538'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		60'438	723'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2023		166'351	251'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.08.2023		926'000	607'654		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.08.2023		864'000	111'812		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.08.2023		1'990'000	102'078		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.08.2023		527'000	585'776		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		6'290'000	6'065'529		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.08.2023		1'974'000	170'030		NOK/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SGD Verfall 04.08.2023		248'000	161'690	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		396'231'000	2'445'336	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		23'503'000	2'832'605	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.08.2023		558'000	120'871	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		13'425'000	11'606'288	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.08.2023		497'000	291'628	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.08.2023		548'000	295'219	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2023		2'188'000	183'293	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 04.08.2023		121'566'000	3'079'388	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.08.2023		6'800'000	582'729	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		17'759'490'000	108'363'435	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.08.2023		7'580'000	1'644'580	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.08.2023		2'001'000	1'079'455	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		215'199'000	205'653'526	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		668'836'000	81'157'898	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 04.08.2023		32'696'000	1'308'933	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.08.2023		22'258'000	13'000'052	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		481'886'000	417'697'339	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.08.2023		32'434'000	36'168'062	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.08.2023		3'062'000	1'998'834	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.08.2023		63'544'000	3'296'872	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2023		40'839'000	3'368'646	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.08.2023		12'709'000	1'629'751	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.08.2023		38'653'000	25'455'010	CAD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 04.08.2023		10'393'110	15'332'747'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 04.08.2023		15'332'747'000	10'480'390	KRW/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.08.2023		993'362	4'132'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.08.2023		53'196	220'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.08.2023		465'000	111'265	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.08.2023		3'887'000	919'653	ILS/CHF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.09.2023		3'082'759	121'801'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		914'190	3'874'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2023		578'299	6'765'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		107'529'046	17'595'694'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		1'645'605	7'625'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		1'068'126	1'987'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		205'384'832	215'340'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		81'449'755	671'673'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 06.09.2023		1'330'202	33'244'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		13'021'736	22'350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		414'384'736	479'763'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		36'326'501	32'687'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2023		1'997'982	3'067'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		3'267'006	63'578'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		1'629'208	12'726'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		25'063'788	38'179'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2023		3'383'105	41'097'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 06.09.2023		131'139	3'295'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		395'533	744'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		221'947	4'356'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2023		246'773	3'028'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		258'812	452'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		3'213'998	26'417'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		1'378'051	224'814'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		3'417'379	3'571'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		146'574	1'141'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		456'245	696'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		985'195	888'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		9'781'318	11'186'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		51'955	218'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		3'699'493	3'865'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		2'299'975	19'040'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		872'199	785'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		7'437'922	8'517'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		306'151	472'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		2'301'673	375'711'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		2'281'626	18'913'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		81'468	156'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2023		128'077	1'550'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		316'948	283'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		257'595	397'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		1'866'408	307'387'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		4'229'373	4'418'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		8'476'090	9'634'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AUD/CHF	Verfall 06.09.2023		436'196	773'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 06.09.2023		67'934'000	3'564'117	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 06.09.2023		3'067'000	2'005'879	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 06.09.2023		4'092'000	951'548	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 06.09.2023		121'801'000	3'072'308	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.09.2023		227'194'000	217'787'032	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.09.2023		18'503'606'000	112'271'555	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.09.2023		34'643'000	38'770'713	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 06.09.2023		36'539'000	1'453'204	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 06.09.2023		44'125'000	3'559'387	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 06.09.2023		13'867'000	1'783'504	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 06.09.2023		7'625'000	1'633'847	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.09.2023		509'100'000	449'635'084	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 06.09.2023		2'887'000	1'518'302	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 06.09.2023		8'315'000	690'436	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.09.2023		23'575'000	13'485'678	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.09.2023		39'744'000	25'945'519	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 06.09.2023		736'043'000	89'310'722	CNY/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 06.09.2023		11'564'227	16'959'216'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 06.09.2023		16'959'216'000	11'270'829	KRW/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 03.10.2023		713'945'000	89'650'074	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.10.2023		39'613'000	26'802'235	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.10.2023		23'322'000	13'770'242	AUD/CHF		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.10.2023		3'480'124	66'869'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.10.2023		1'959'766	3'002'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.10.2023		949'015	4'090'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 04.10.2023		3'052'567	121'212'000	CHF/THB		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.10.2023		216'953'989	226'710'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.10.2023		111'448'218	18'341'974'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.10.2023		38'225'517	34'256'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 04.10.2023		1'432'326	36'165'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.10.2023		3'540'743	43'968'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.10.2023		1'781'709	13'873'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 04.10.2023		1'648'030	7'727'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.10.2023		444'214'120	504'509'000	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.10.2023		1'504'841	2'870'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 04.10.2023		557'594	6'730'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.10.2023		13'454'382	23'568'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.10.2023		25'790'836	39'613'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.10.2023		194'511'000	1'179'563	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.10.2023		980'000	934'783	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.10.2023		5'344'000	4'710'415	USD/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.10.2023		199'109	179'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.10.2023		246'000	140'135	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 04.10.2023		43'968'000	3'702'413	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 04.10.2023		13'873'000	1'801'881	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.10.2023		225'730'000	218'628'534	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.10.2023		499'165'000	456'614'678	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 04.10.2023		36'165'000	1'438'047	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.10.2023		18'147'463'000	111'261'733	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 04.10.2023		3'002'000	2'012'057	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 04.10.2023		6'730'000	578'618	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.10.2023		34'435'000	38'446'815	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 04.10.2023		66'869'000	3'519'342	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 04.10.2023		4'090'000	982'892	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 04.10.2023		7'727'000	1'619'139	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 04.10.2023		121'212'000	3'046'094	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 04.10.2023		2'870'000	1'577'427	NZD/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 04.10.2023		11'193'386	16'882'200'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 04.10.2023		16'882'200'000	11'405'274	KRW/CHF		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 10.10.2023		89'559'272	739'878'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 10.10.2023		8'566'000	1'039'724	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 10.10.2023		17'367'000	2'167'818	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 02.11.2023		59'613'000	3'005'234	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 02.11.2023		7'749'000	1'673'381	PLN/CHF		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.11.2023		3'688'804	43'895'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.11.2023		1'765'054	13'612'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 03.11.2023		89'004'854	710'232'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.11.2023		211'680'370	218'988'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.11.2023		443'680'977	486'583'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 03.11.2023		1'413'076	35'695'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.11.2023		1'998'882	2'988'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 03.11.2023		572'594	6'676'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.11.2023		25'856'313	38'322'000	CHF/CAD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		37'716'285	33'883'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		3'380'358	64'766'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		13'517'373	22'943'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2023		1'617'085	7'749'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 03.11.2023		2'954'029	117'674'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.11.2023		1'554'881	2'838'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		8'684'000	7'957'253	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		1'205'000	808'250	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2023		2'776'000	230'910	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		429'000	250'731	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		727'000	807'503	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.11.2023		5'153'000	267'504	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2023		438'000	421'771	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		361'000	326'597	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.11.2023		13'612'000	1'754'110	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 03.11.2023		117'674'000	2'982'542	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		22'514'000	12'972'409	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.11.2023		2'988'000	1'984'606	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		33'156'000	36'612'646	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2023		41'119'000	3'348'546	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.11.2023		2'838'000	1'502'187	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		477'538'000	434'579'159	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		37'117'000	24'328'189	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2023		218'550'000	210'210'132	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		710'232'000	88'031'126	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 03.11.2023		35'695'000	1'396'656	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.11.2023		6'676'000	543'727	NOK/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 03.11.2023		11'267'006	16'717'770'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 03.11.2023		16'717'770'000	11'190'584	KRW/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		110'837'382	18'047'135'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.11.2023		962'117	4'013'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		476'639'000	2'929'195	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.11.2023		4'013'000	902'604	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		17'570'496'000	105'610'102	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		3'935'000	918'732	ILS/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.12.2023		1'769'393	13'756'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		2'967'683	59'390'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		12'713'515	22'117'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2023		1'989'810	3'002'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		36'214'295	32'901'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		872'498	3'888'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.12.2023		3'351'527	41'245'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		104'241'925	17'317'718'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.12.2023		1'491'418	2'827'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		1'676'199	7'792'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		426'522'158	470'299'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		24'384'512	37'314'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		210'283'844	219'092'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		88'028'367	711'099'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.12.2023		1'406'626	36'118'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.12.2023		546'366	6'725'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		683'176	621'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		10'631	47'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		1'101'537	182'422'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		1'705'277	13'763'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		985'022	1'029'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		308'612	472'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		4'140'188	4'563'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		105'174	182'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.12.2023		6'725'000	542'405	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		17'500'140'000	102'934'948	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2023		59'390'000	2'971'911	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		474'862'000	412'854'995	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.12.2023		3'002'000	1'955'746	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.12.2023		36'118'000	1'406'760	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		220'121'000	208'815'365	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		724'862'000	88'262'821	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		37'786'000	24'230'235	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2023		33'522'000	36'895'654	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.12.2023		41'245'000	3'421'912	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.12.2023		13'756'000	1'750'382	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.12.2023		2'827'000	1'518'093	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.12.2023		7'792'000	1'697'776	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2023		22'299'000	12'855'262	AUD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	KRW/CHF Verfall 05.12.2023		10'983'992	16'440'685'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.12.2023	16'440'685'000		11'081'436	KRW/CHF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.12.2023		2'961'635	117'032'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.12.2023	117'032'000		2'892'446	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024	18'648'870'000		111'328'159	JPY/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2024		555'606	6'907'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024	105'335'812		17'881'805'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		3'097'921	62'446'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024	431'232'859		497'791'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		1'998'371	3'074'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.01.2024		1'435'090	36'812'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024	214'465'014		226'558'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024	88'292'579		726'150'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024	25'233'976		39'472'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024	37'998'475		34'638'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024	3'474'127		41'954'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.01.2024	1'787'116		14'072'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.01.2024	1'560'006		2'915'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 05.01.2024	2'936'740		119'039'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2024	1'699'840		7'839'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024	13'242'481		23'029'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		32'557	50'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024	4'391'632		4'656'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024	209'750		4'191'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024	75'072		130'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024	293'366		3'518'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.01.2024	51'775		1'340'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024	742'632		676'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024	2'874'653		23'578'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024	9'527'959		10'961'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024	1'882'912		318'210'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2024	72'778		896'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024	886'058		1'377'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2024	168'838		775'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024	58'491		62'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024	51'082		89'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024	781'774		714'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024	68'539		119'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.01.2024	85'122		159'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024	3'570'432		3'781'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024	2'712'238		448'855'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024	1'861'149		15'282'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024	4'509'608		5'160'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024	228'022		354'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024	765'010'000		90'416'532	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024	3'124'000		1'993'112	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024	41'203'000		26'296'373	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024	66'637'000		3'310'913	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 05.01.2024	119'039'000		2'935'145	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024	513'912'000		432'468'254	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.01.2024	7'803'000		646'529	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.01.2024	38'152'000		1'436'690	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024	23'367'000		13'418'733	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024	36'028'000		38'650'550	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024	235'057'000		218'506'637	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2024	14'072'000		1'754'891	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2024	45'472'000		3'796'776	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024	8'614'000		1'843'456	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.01.2024	3'074'000		1'637'873	NZD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.01.2024	11'608'695		17'270'023'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.01.2024	17'270'023'000		11'250'419	KRW/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.01.2024	947'660		4'071'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.01.2024	195'491		828'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.01.2024	4'899'000		1'144'798	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024	4'950'000		1'167'170	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024	91'156'356		772'649'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024	2'026'129		3'182'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024	27'181'443		42'713'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024	1'153'310		4'950'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 05.02.2024	2'982'488		121'195'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024	447'283'490		533'272'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024	657'071		7'951'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.02.2024	1'476'479		39'388'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024	13'808'892		24'104'000	CHF/AUD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		40'864'372	38'210'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		226'421'103	244'069'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		1'807'091	14'517'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		3'872'204	46'475'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		1'868'315	8'763'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		112'290'881	18'779'969'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		1'689'938	3'182'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		1'003'515	1'576'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		1'083'111	1'009'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		85'379	1'041'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		366'820	61'686'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		16'684'625	19'635'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		2'995'360	25'226'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		497'989	872'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		120'482	968'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.02.2024		158'751	4'227'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		5'371'138	5'789'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		273'184	1'284'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		91'891	144'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		13'027'856	15'377'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		6'048'280	6'509'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		879'157	817'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		726'064	1'144'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		2'748'819	23'236'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		354'540	623'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		4'990'349	848'243'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		5'410'900	6'404'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		76'889	927'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		814'688	756'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		47'829	384'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		505'217	887'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		2'024'579	17'107'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		100'645	190'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		862'785	1'360'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		82'068	994'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		3'477'719	3'745'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		1'245'765	211'638'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		1'190'406	202'364'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		1'584'982	1'687'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		250'033	227'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		71'948	112'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		1'152'613	9'540'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		3'362'716	3'877'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 05.02.2024		121'195'000	2'930'374		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		3'372'000	1'780'146		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		3'326'000	2'134'853		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		41'019'000	44'797'916		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		46'905'000	30'109'961		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		26'486'000	15'017'138		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		47'402'000	3'935'551		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		578'565'000	496'186'022		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		20'103'900'000	118'004'867		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		10'047'000	2'163'149		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		9'986'000	819'162		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		15'869'000	1'983'800		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		261'799'000	243'910'274		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		847'758'000	101'366'424		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.02.2024		43'615'000	1'631'890		CZK/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.02.2024		11'442'485	17'614'459'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.02.2024		1'617'164	2'508'222'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.02.2024		20'122'681'000	13'030'470		KRW/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		3'360'602	68'222'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		12'645	255'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		29'091	584'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		69'061'000	3'445'840		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		4'895'000	1'206'757		ILS/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 05.03.2024		2'965'515	122'928'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.03.2024		1'756'186	3'337'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.03.2024		2'108'379	3'291'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		43'377'341	39'836'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		29'465'925	46'029'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		14'897'026	26'333'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.03.2024		3'905'062	47'129'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		491'228'049	574'611'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
MXN/CHF	Verfall 05.03.2024		3'386'902	68'409'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		117'336'613	19'962'064'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 05.03.2024		2'154'152	10'040'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.03.2024		806'844	9'860'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.03.2024		1'958'175	15'690'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		240'947'198	259'117'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 05.03.2024		102'065'918	854'938'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 05.03.2024		1'620'938	43'490'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.03.2024		1'151'456	4'895'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		1'374'348	1'476'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 05.03.2024		11'003	294'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.03.2024		2'069'000	247'663	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.03.2024		106'000	59'654	AUD/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.03.2024		415'122	381'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.03.2024		22'722	455'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 05.03.2024		11'212	52'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.03.2024		325'261'000	1'918'793	JPY/CHF		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.03.2024		13'247	106'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		1'649'859	1'921'000	CHF/USD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.03.2024		10'463	127'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.03.2024		106'325	166'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.03.2024		11'528'000	1'392'352	CNY/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		1'288'964	1'368'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 05.03.2024		10'092'000	2'228'233	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 05.03.2024		46'195'000	29'989'193	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.03.2024		19'636'803'000	115'529'399	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.03.2024		26'227'000	15'037'460	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.03.2024		261'961'000	249'619'493	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 05.03.2024		68'864'000	3'551'950	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 05.03.2024		3'337'000	1'790'120	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 05.03.2024		122'928'000	3'018'005	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 05.03.2024		9'860'000	819'208	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.03.2024		841'341'000	102'811'870	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 05.03.2024		43'784'000	1'648'555	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 05.03.2024		3'291'000	2'155'217	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 05.03.2024		47'256'000	4'021'746	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 05.03.2024		15'796'000	2'019'274	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.03.2024		40'217'000	44'793'695	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.03.2024		576'532'000	507'635'273	USD/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 06.03.2024		12'537'867	19'398'325'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 06.03.2024		19'398'325'000	12'781'076	KRW/CHF		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 04.04.2024		2'213'309	10'061'000	CHF/PLN		0.00	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 04.04.2024		29'711'097	45'896'000	CHF/CAD		0.00	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 04.04.2024		116'423'384	19'759'972'000	CHF/JPY		0.00	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 04.04.2024		14'924'756	26'091'000	CHF/AUD		0.00	0.00	b)
ILS/CHF	Verfall 04.04.2024		1'209'936	4'920'000	CHF/ILS		0.00	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 04.04.2024		245'827'924	258'508'000	CHF/EUR		0.00	0.00	b)
MXN/CHF	Verfall 04.04.2024		3'532'119	69'037'000	CHF/MXN		0.00	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 04.04.2024		1'781'657	3'332'000	CHF/NZD		0.00	0.00	b)
THB/CHF	Verfall 04.04.2024		3'052'996	124'665'000	CHF/THB		0.00	0.00	b)
NOK/CHF	Verfall 04.04.2024		808'446	9'755'000	CHF/NOK		0.00	0.00	b)
CZK/CHF	Verfall 04.04.2024		1'646'964	43'901'000	CHF/CZK		0.00	0.00	b)
SGD/CHF	Verfall 04.04.2024		2'125'462	3'252'000	CHF/SGD		0.00	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 04.04.2024		3'979'659	46'857'000	CHF/SEK		0.00	0.00	b)
DKK/CHF	Verfall 04.04.2024		1'996'904	15'648'000	CHF/DKK		0.00	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 04.04.2024		43'842'678	39'484'000	CHF/GBP		0.00	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		498'341'081	567'824'000	CHF/USD		-0.01	0.00	b)
KRW/CHF	Verfall 04.04.2024		12'486'365	18'989'127'000	CHF/KRW		0.00	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 08.04.2024		103'333'181	847'153'000	CHF/CNY		0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-0.01	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	30'611'975.08	2.80
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	604'854'927.79	55.37
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	451'066'415.74	41.29
Derivative Finanzinstrumente	-0.01	0.00
Sonstige Vermögenswerte	5'856'916.11	0.54
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'092'390'234.71	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-11'672'862.09	
Andere Verbindlichkeiten	-17'445.67	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'080'699'926.95	

Bewertungskategorien		Kurswert CHF	in % 7)
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'055'921'343.53	96.66
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-0.01	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Die unter der Bewertungskategorie c) aufgeführten Wertpapiere mit Domizil Russland wurden aufgrund des Ukraine-Krieges und den damit verbundenen Finanzsanktionen (u.a. Verbot von Transaktionen mit der russischen Zentralbank) mit einem entsprechenden Preisabschlag bewertet.

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

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

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'089'826'663.34	100.845

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.158	0.00 - 0.05	-	0.009
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.158	0.00 - 0.05	-	0.009
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.158	0.00 - 0.05	-	0.009

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FAH1 CHF	0.200	0.550	0.100	0.100	3.000
GTH1 CHF	0.150	0.400	0.100	0.050	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

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

8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Bond ex CHF Index TR

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FAH1 CHF	Nein	CHF	1.75000	0.61250	1.13750

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GTH1 CHF	Nein	CHF	1.944	0.680	1.264
NTH1 CHF	Nein	CHF	2.087	0.730	1.357

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

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

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

mit den Teilvermögen

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

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

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Begründung für die Vereinigung

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigung

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

7 Kosten

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

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

II Änderungen im Fondsvertrag

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

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

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

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

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

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

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

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

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

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

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

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

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

* * *

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

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

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

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

betreffend

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

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

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

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

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

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

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich