



# BEKB OBLIGATIONEN CHF

Jahresbericht per 31.08.2024

Teilvermögen des BEKB Obligationenfonds  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
A	30460996	CHF
B	30528083	CHF
It	24652013	CHF
Nt	24652057	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 20.12.2024

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

BEKB Obligationenfonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ BEKB Obligationen CHF
- ▶ BEKB Obligationen Global Staatsanleihen
- ▶ BEKB Obligationen Global Unternehmensanleihen
- ▶ BEKB Obligationen Nachhaltig CHF
- ▶ BEKB Obligationen Nachhaltig Global
- ▶ BEKB Obligationen CHF Short Duration

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 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), geprüft.

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



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

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



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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 31. August 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	18
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	18
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	19
7	Verwaltungskommission	19
8	Benchmark	19
9	TER	19
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	20
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	20
12	Fussnoten	20
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	21

# 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 Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern  
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**

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.09.2023	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020
	bis	31.08.2024	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'065'630'345.21	1'010'395'016.73	894'537'480.25	759'924'468.36
<b>Klasse A</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'711'390.15	10'027'748.51	10'802'931.16	13'399'147.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		116'519.596	115'533.694	126'451.901	138'385.671
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		91.93	86.80	85.43	96.82
Ausschüttung je Anteil		0.60	0.35	0.20	0.30
Zwischenausschüttung je Anteil		-	-	0.10	-
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
<b>Klasse B</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'534'843.66	1'996'055.89	2'748'448.45	3'194'973.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'804.587	22'412.587	31'403.357	32'295.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		94.57	89.06	87.52	98.93
Thesaurierung je Anteil		0.62	0.36	0.18	0.37
Zwischenausschüttung je Anteil		-	-	0.06	-
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
<b>Klasse It</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		76'583'231.54	38'082'321.15	40'920'341.70	38'008'442.80
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		763'080.539	404'021.292	442'950.292	364'915.644
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.36	94.26	92.38	104.16
Thesaurierung je Anteil		1.05	0.76	0.57	0.82
Zwischenausschüttung je Anteil		-	-	0.09	-
Total Expense Ratio (TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
<b>Klasse Nt</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		975'800'879.86	960'288'891.18	840'065'758.94	705'321'904.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'596'245.212	10'065'807.340	8'992'948.544	6'704'304.667
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.69	95.40	93.41	105.20
Thesaurierung je Anteil		1.22	0.91	0.75	0.99
Zwischenausschüttung je Anteil		-	-	0.07	-
Total Expense Ratio (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 A	6.33 %	7.59 %	-12.38 %	-2.31 %
Klasse B	6.33 %	7.58 %	-12.37 %	-2.31 %
Klasse It	6.76 %	8.01 %	-12.01 %	-1.91 %
Klasse Nt	6.94 %	8.20 %	-11.87 %	-1.76 %
Benchmark	6.19 %	7.36 %	-12.10 %	1.82 %
Tracking Error 33)	0.27 %	0.35 %	0.61 %	0.17 %

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 A	0.14 %
Klasse B	0.14 %
Klasse It	0.57 %
Klasse Nt	0.75 %

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)	31.08.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	3'586'232.28	2'183'602.04
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'053'285'317.80	1'001'568'440.61
Sonstige Vermögenswerte	8'801'923.74	6'679'568.00
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'065'673'473.82</b>	<b>1'010'431'610.65</b>
Andere Verbindlichkeiten	-43'128.61	-36'593.92
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'065'630'345.21</b>	<b>1'010'395'016.73</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Klasse A</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		115'533.694	126'451.901
Ausgegebene Anteile		9'286.786	1'995.000
Zurückgenommene Anteile		-8'300.884	-12'913.207
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>116'519.596</b>	<b>115'533.694</b>
<b>Klasse B</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'412.587	31'403.357
Ausgegebene Anteile		5'628.000	225.362
Zurückgenommene Anteile		-1'236.000	-9'216.132
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>26'804.587</b>	<b>22'412.587</b>
<b>Klasse It</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		404'021.292	442'950.292
Ausgegebene Anteile		392'179.365	4'740.000
Zurückgenommene Anteile		-33'120.118	-43'669.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>763'080.539</b>	<b>404'021.292</b>
<b>Klasse Nt</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'065'807.340	8'992'948.544
Ausgegebene Anteile		831'792.374	1'010'116.766
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		257'561.389	1'967'726.680
Zurückgenommene Anteile		-1'558'915.891	-1'751'723.324
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-153'261.326
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>9'596'245.212</b>	<b>10'065'807.340</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse Nt	24.06.2024	25'637'660.66	257'561.389

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'010'395'016.73	894'537'480.25
Ausbezahlte Ausschüttung		-38'724.98	-24'038.06
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'326'639.95	-2'934'129.29
Saldo aus dem Anteilverkehr		-11'244'240.43	89'950'678.96
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		69'844'933.84	28'865'024.87
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'065'630'345.21</b>	<b>1'010'395'016.73</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		78'544.37	8'101.60
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-1'378.70
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		13'115'053.55	10'110'045.67
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		933'839.43	715'704.53
<b>Total Ertrag</b>		<b>14'127'437.35</b>	<b>10'832'473.10</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-483'636.55	-431'466.13
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-955'433.51	-808'412.27
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'439'070.06</b>	<b>-1'239'878.40</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>12'688'367.29</b>	<b>9'592'594.70</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-7'069'765.62	-23'134'197.25
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		833'211.24	630'891.04
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>6'451'812.91</b>	<b>-12'910'711.51</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		63'393'120.93	41'775'736.38
<b>Gesamterfolg</b>		<b>69'844'933.84</b>	<b>28'865'024.87</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	71'073.86	40'424.43
Vortrag des Vorjahres	4'307.19	4'319.55
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>75'381.05</b>	<b>44'743.98</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	69'911.76	40'436.79
Vortrag auf neue Rechnung	5'469.29	4'307.19
<b>Total</b>	<b>75'381.05</b>	<b>44'743.98</b>

Klasse B	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	16'800.85	8'118.28
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>16'800.85</b>	<b>8'118.28</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	5'880.30	2'841.40
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	10'920.55	5'276.88
<b>Total</b>	<b>16'800.85</b>	<b>8'118.28</b>

Klasse It	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	808'372.34	307'057.15
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>808'372.34</b>	<b>307'057.15</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	282'930.32	107'470.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	525'442.02	199'587.15
<b>Total</b>	<b>808'372.34</b>	<b>307'057.15</b>

Klasse Nt	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	11'792'120.24	9'236'994.84
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>11'792'120.24</b>	<b>9'236'994.84</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'127'242.08	3'232'948.19
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	7'664'878.16	6'004'046.65
<b>Total</b>	<b>11'792'120.24</b>	<b>9'236'994.84</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>1'053'285'317.80</b>	<b>98.84</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'053'285'317.80</b>	<b>98.84</b>	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>AE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	4'000	55	0	4'055 CHF	103.00%	4'176'650.00	0.39 a)	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'500	20	0	1'520 CHF	104.95%	1'595'240.00	0.15 a)	
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	2'500	40	1'000	1'540 CHF	102.00%	1'570'800.00	0.15 a)	
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	2'000	30	0	2'030 CHF	103.35%	2'098'005.00	0.20 a)	
CH1271007952	2.3750 % HYN0E 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	2'025	0	2'025 CHF	103.00%	2'085'750.00	0.20 a)	
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	1'500	20	500	1'020 CHF	103.95%	1'060'290.00	0.10 a)	
<b>AT</b>							<b>12'586'735.00</b>	<b>1.18</b>	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	99.65%	1'993'000.00	0.19 a)	
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	5'000	80	2'080	3'000 CHF	103.85%	3'115'500.00	0.29 a)	
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	2'000	125	0	2'125 CHF	105.50%	2'241'875.00	0.21 a)	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	4'000	70	0	4'070 CHF	105.30%	4'285'710.00	0.40 a)	
<b>AU</b>							<b>11'636'085.00</b>	<b>1.09</b>	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	0	165	0	165 CHF	93.90%	154'935.00	0.01 a)	
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'800	110	0	1'910 CHF	94.85%	1'811'635.00	0.17 a)	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 CHF	102.90%	2'058'000.00	0.19 a)	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	2'000	25	0	2'025 CHF	102.50%	2'075'625.00	0.19 a)	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.85%	2'077'000.00	0.19 a)	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	2'000	60	0	2'060 CHF	103.75%	2'137'250.00	0.20 a)	
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	2'000	55	0	2'055 CHF	105.65%	2'171'107.50	0.20 a)	
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	2'500	0	0	2'500 CHF	103.40%	2'585'000.00	0.24 a)	
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	2'500	30	0	2'530 CHF	101.95%	2'579'335.00	0.24 a)	
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	1'520	0	1'520 CHF	103.25%	1'569'400.00	0.15 a)	
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	1'500	0	1'500 CHF	104.25%	1'563'750.00	0.15 a)	
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	103.75%	1'582'187.50	0.15 a)	
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	1'500	0	1'500 CHF	99.83%	1'497'375.00	0.14 a)	
<b>CA</b>							<b>23'862'600.00</b>	<b>2.24</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	0	446	446	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	3'500	0	0	3'500 CHF	181.70%	6'359'500.00	0.60 a)	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	15'000	0	0	15'000 CHF	125.61%	18'841'500.00	1.77 a)	
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	8'100	1'900	0	10'000 CHF	122.98%	12'298'000.00	1.15 a)	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	4'000	557	4'000	557 CHF	107.64%	599'554.80	0.06 a)	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	5'050	0	1'050	4'000 CHF	100.84%	4'033'600.00	0.38 a)	
CH0115967397	2.2500 % PSYPO 2 1/4 08/13/32 519	0	220	0	220 CHF	109.61%	241'142.00	0.02 a)	
CH0117076379	1.8750 % PSYPO 1 7/8 09/15/31 524	15'000	220	0	15'220 CHF	106.12%	16'151'464.00	1.52 a)	
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	17'500	0	2'500	15'000 CHF	111.80%	16'770'000.00	1.57 a)	
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	14'500	0	1'500	13'000 CHF	109.87%	14'283'100.00	1.34 a)	
CH0128891105	2.7500 % PSYPO 2 3/4 12/15/26 553	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	0	135	135	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	2'250	0	0	2'250 CHF	101.20%	2'277'000.00	0.21	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	5'400	110	0	5'510 CHF	104.75%	5'771'725.00	0.54	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42	2'060	0	0	2'060 CHF	113.85%	2'345'310.00	0.22	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	3'000	80	0	3'080 CHF	102.55%	3'158'540.00	0.30	a)
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	0	330	330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	8'500	555	2'500	6'555 CHF	102.13%	6'694'621.50	0.63	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	400	0	0	400 CHF	120.70%	482'800.00	0.05	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	0	195	195	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	2'100	220	0	2'320 CHF	103.85%	2'409'320.00	0.23	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	0	110	0	110 CHF	103.10%	113'410.00	0.01	a)
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	1'430	0	0	1'430 CHF	121.40%	1'736'020.00	0.16	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	0	220	0	220 CHF	103.81%	228'382.00	0.02	a)
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'850	0	0	1'850 CHF	111.40%	2'060'900.00	0.19	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	3'950	0	1'950	2'000 CHF	163.00%	3'260'000.00	0.31	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	17'500	223	2'723	15'000 CHF	100.01%	15'001'500.00	1.41	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	5'850	0	850	5'000 CHF	103.24%	5'162'000.00	0.48	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	6'000	167	0	6'167 CHF	97.67%	6'023'308.90	0.57	a)
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	3'300	0	0	3'300 CHF	102.40%	3'379'200.00	0.32	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	0	2'000	0	2'000 CHF	100.01%	2'000'200.00	0.19	a)
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	0	1'000	0	1'000 CHF	99.99%	999'900.00	0.09	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	0	110	0	110 CHF	99.97%	109'967.00	0.01	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	0	120	0	120 CHF	99.62%	119'544.00	0.01	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	3'700	170	0	3'870 CHF	98.20%	3'800'340.00	0.36	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	3'000	470	0	3'470 CHF	98.46%	3'416'562.00	0.32	a)
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	160	160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	8'500	0	2'000	6'500 CHF	96.36%	6'263'400.00	0.59	a)
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	5'000	25	0	5'025 CHF	97.65%	4'906'912.50	0.46	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	10'000	165	2'165	8'000 CHF	99.26%	7'940'800.00	0.75	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	4'000	330	4'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	10'000	0	2'000	8'000 CHF	99.33%	7'946'400.00	0.75	a)
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	5'030	110	2'530	2'610 CHF	98.15%	2'561'715.00	0.24	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'200	330	2'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	2'000	0	500	1'500 CHF	99.57%	1'493'550.00	0.14	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	0	275	275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	3'000	0	0	3'000 CHF	98.50%	2'955'000.00	0.28	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403777	0.3750 % PPSNSW 0 3/8 04/29/26	0	215	0	215 CHF	98.50%	211'775.00	0.02	a)
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	0	195	0	195 CHF	95.48%	186'186.00	0.02	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	0	110	0	110 CHF	99.47%	109'417.00	0.01	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	0	2'000	0	2'000 CHF	99.20%	1'984'000.00	0.19	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	5'100	0	0	5'100 CHF	97.83%	4'989'330.00	0.47	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	0	165	0	165 CHF	94.09%	155'248.50	0.01	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	1'250	1'750	0	3'000 CHF	102.10%	3'063'000.00	0.29	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	1'330	1'170	0	2'500 CHF	100.64%	2'516'000.00	0.24	a)
CH0347556927	0.6250 % PSYPO 0 5/8 01/23/37 645	5'000	0	0	5'000 CHF	95.05%	4'752'500.00	0.45	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBSW 0.2 02/02/26	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	0	330	0	330 CHF	98.36%	324'588.00	0.03	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLLI 2 12/11/23	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	3'500	0	0	3'500 CHF	97.72%	3'420'200.00	0.32	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	3'000	135	3'000	135 CHF	97.75%	131'962.50	0.01	a)
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	2'600	0	0	2'600 CHF	97.80%	2'542'800.00	0.24	a)
CH0370943547	0.2500 % PSYPO 0 1/4 10/20/26 651	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476164	0.7500 % SCMNIX 0 3/4 11/24/33	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	2'000	0	0	2'000 CHF	98.05%	1'961'000.00	0.18	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	5'500	220	2'500	3'220 CHF	98.20%	3'162'040.00	0.30	a)
CH0373945093	0.2500 % PSYPO 0 1/4 10/12/27 653	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSYPO 0 1/4 09/18/26 654	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	5'000	110	0	5'110 CHF	100.38%	5'129'418.00	0.48	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	0	130	0	130 CHF	97.75%	127'075.00	0.01	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	800	500	800	500 CHF	97.91%	489'550.00	0.05	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	0	275	0	275 CHF	99.83%	274'532.50	0.03	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	5'000	0	0	5'000 CHF	98.64%	4'932'000.00	0.46	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	2'050	105	0	2'155 CHF	98.20%	2'116'210.00	0.20	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	3'700	55	1'200	2'555 CHF	97.70%	2'496'235.00	0.23	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	10'000	0	0	10'000 CHF	97.31%	9'731'000.00	0.91	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	7'000	0	2'000	5'000 CHF	98.85%	4'942'500.00	0.46	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	12'500	425	6'925	6'000 CHF	96.25%	5'775'000.00	0.54	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'300	110	0	2'410 CHF	94.50%	2'277'450.00	0.21	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	4'550	0	1'550	3'000 CHF	97.10%	2'913'000.00	0.27	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	3'000	0	0	3'000 CHF	95.00%	2'850'000.00	0.27	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	4'000	0	1'000	3'000 CHF	84.95%	2'548'500.00	0.24	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233516	0.2500 % PSYPO 0 1/4 11/17/25 659	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233524	0.5000 % PSYPO 0 1/2 01/22/29 660	2'000	0	0	2'000 CHF	98.12%	1'962'400.00	0.18	a)
CH0434678402	1.1250 % PSYPO 1 1/8 10/09/48 664	0	2'000	0	2'000 CHF	102.72%	2'054'400.00	0.19	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	1'500	0	0	1'500 CHF	99.98%	1'499'700.00	0.14	a)
CH0438965581	1.1250 % PSYPO 1 1/8 10/18/47 665	0	2'055	0	2'055 CHF	103.00%	2'116'650.00	0.20	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	500	2'500	0	3'000 CHF	93.28%	2'798'400.00	0.26	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	0	2'000	0	2'000 CHF	114.25%	2'285'000.00	0.21	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	0	110	0	110 CHF	93.67%	103'037.00	0.01	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	3'000	0	0	3'000 CHF	93.90%	2'817'000.00	0.26	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	4'500	0	0	4'500 CHF	93.60%	4'212'000.00	0.40	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	6'000	0	4'000	2'000 CHF	97.30%	1'946'000.00	0.18	a)
CH0471297926	0.2500 % PSYPO 0 1/4 04/15/30 671	2'000	0	0	2'000 CHF	96.13%	1'922'600.00	0.18	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252800	0.0000 % PSYPO 0 06/15/27 675	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252818	0.2500 % PSYPO 0 1/4 04/26/34 676	3'500	0	0	3'500 CHF	92.80%	3'248'000.00	0.30	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	6'500	110	0	6'610 CHF	94.15%	6'223'315.00	0.58	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	3'600	0	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	2'500	75	500	2'075 CHF	92.85%	1'926'637.50	0.18	a)
CH0506071379	0.2500 % AMALEA 0 1/4 10/27/23	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	8'950	105	0	9'055 CHF	98.64%	8'931'852.00	0.84	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0515152467	0.1300 % SCMNIX 0.13 09/18/31	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	2'500	20	2'520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	8'200	0	1'200	7'000 CHF	91.10%	6'377'000.00	0.60	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	1'000	0	0	1'000 CHF	110.35%	1'103'500.00	0.10	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	6'150	80	1'150	5'080 CHF	96.83%	4'918'964.00	0.46	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	9'000	110	0	9'110 CHF	94.89%	8'644'479.00	0.81	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	3'700	0	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'500	0	0	2'500 CHF	91.20%	2'280'000.00	0.21	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	1'500	0	0	1'500 CHF	97.68%	1'465'200.00	0.14	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	8'500	115	3'615	5'000 CHF	96.80%	4'840'000.00	0.45	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	6'500	0	1'500	5'000 CHF	99.70%	4'985'000.00	0.47	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	900	0	0	900 CHF	97.84%	880'560.00	0.08	a)
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	2'000	0	2'000 CHF	113.96%	2'279'200.00	0.21	a)
CH0557778872	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 OCT	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778906	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 NOV	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778914	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778922	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 JAN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778930	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 JAN	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778955	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45 FEB	0	1'170	1'170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'000	0	0	1'000 CHF	97.95%	979'500.00	0.09	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	3'000	0	0	3'000 CHF	96.35%	2'890'500.00	0.27	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	3'000	0	1'500	1'500 CHF	98.00%	1'470'000.00	0.14	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'250	0	0	2'250 CHF	95.75%	2'154'375.00	0.20	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	3'500	0	0	3'500 CHF	99.53%	3'483'550.00	0.33	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	2'400	0	0	2'400 CHF	90.77%	2'178'480.00	0.20	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	2'900	100	0	3'000 CHF	93.90%	2'817'000.00	0.26	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	3'550	0	0	3'550 CHF	97.10%	3'447'050.00	0.32	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	12'000	65	5'000	7'065 CHF	96.84%	6'841'746.00	0.64	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	2'500	330	0	2'830 CHF	94.35%	2'670'105.00	0.25	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBNSW 0.1 04/18/31	6'500	175	3'500	3'175 CHF	93.05%	2'954'337.50	0.28	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.25%	982'500.00	0.09	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	4'055	0	2'055	2'000 CHF	98.00%	1'960'000.00	0.18	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'700	80	0	1'780 CHF	92.35%	1'643'830.00	0.15	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	9'400	0	0	9'400 CHF	93.18%	8'758'920.00	0.82	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	2'000	150	0	2'150 CHF	92.55%	1'989'825.00	0.19	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	10'000	0	0	10'000 CHF	87.50%	8'750'000.00	0.82	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBNSW 0 1/8 09/15/33	4'500	35	1'500	3'035 CHF	90.45%	2'745'157.50	0.26	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	5'500	0	1'500	4'000 CHF	90.60%	3'624'000.00	0.34	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'300	0	0	2'300 CHF	87.95%	2'022'850.00	0.19	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAAR 0.35 09/30/36	3'200	0	0	3'200 CHF	84.80%	2'713'600.00	0.25	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	3'000	110	3'110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	0	165	0	165 CHF	92.10%	151'965.00	0.01	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	2'700	0	0	2'700 CHF	91.40%	2'467'800.00	0.23	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	4'000	55	0	4'055 CHF	94.65%	3'838'057.50	0.36	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	5'000	95	1'000	4'095 CHF	93.35%	3'822'682.50	0.36	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	2'000	0	0	2'000 CHF	98.67%	1'973'400.00	0.19	a)
CH1139995778	0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	4'250	65	0	4'315 CHF	99.34%	4'286'521.00	0.40	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	1'500	20	0	1'520 CHF	97.50%	1'482'000.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	2'300	0	0	2'300 CHF	86.30%	1'984'900.00	0.19	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	7'600	0	0	7'600 CHF	96.75%	7'353'000.00	0.69	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	5'500	85	0	5'585 CHF	94.15%	5'258'277.50	0.49	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	5'000	420	0	5'420 CHF	93.87%	5'087'754.00	0.48	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'000	0	0	2'000 CHF	91.80%	1'836'000.00	0.17	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	10'000	0	0	10'000 CHF	96.35%	9'635'000.00	0.90	a)
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	1'850	0	0	1'850 CHF	98.35%	1'819'475.00	0.17	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	2'000	5	0	2'005 CHF	98.05%	1'965'902.50	0.18	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	2'150	0	650	1'500 CHF	93.10%	1'396'500.00	0.13	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	8'000	0	0	8'000 CHF	103.00%	8'240'000.00	0.77	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	20'300	0	2'300	18'000 CHF	106.83%	19'229'400.00	1.80	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	2'500	0	0	2'500 CHF	100.10%	2'502'500.00	0.23	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	3'500	0	0	3'500 CHF	102.84%	3'599'400.00	0.34	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	0	2'000	0	2'000 CHF	114.45%	2'289'000.00	0.21	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	9'180	0	680	8'500 CHF	116.50%	9'902'500.00	0.93	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	2'000	0	0	2'000 CHF	103.40%	2'068'000.00	0.19	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	1'000	0	0	1'000 CHF	131.98%	1'319'800.00	0.12	a)
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	1'700	0	0	1'700 CHF	112.60%	1'914'200.00	0.18	a)
CH1204501642	0.0000 % SWNBK 0 12/27/23 30	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	4'000	0	0	4'000 CHF	109.29%	4'371'600.00	0.41	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	2'000	0	0	2'000 CHF	105.65%	2'113'000.00	0.20	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	5'000	0	0	5'000 CHF	111.05%	5'552'500.00	0.52	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	3'000	0	1'500	1'500 CHF	106.74%	1'601'100.00	0.15	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	1'200	0	0	1'200 CHF	116.02%	1'392'240.00	0.13	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	2'000	40	0	2'040 CHF	105.45%	2'151'180.00	0.20	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	2'700	0	0	2'700 CHF	107.85%	2'911'950.00	0.27	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	10'000	0	0	10'000 CHF	109.03%	10'903'000.00	1.02	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	103.10%	3'093'000.00	0.29	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	1'500	45	0	1'545 CHF	108.56%	1'677'252.00	0.16	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	1'725	0	1'725	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	1'660	0	0	1'660 CHF	100.30%	1'664'980.00	0.16	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	0	110	0	110 CHF	104.41%	114'851.00	0.01	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	2'500	10	0	2'510 CHF	109.60%	2'750'960.00	0.26	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	2'000	20	0	2'020 CHF	119.05%	2'404'810.00	0.23	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	1'000	0	0	1'000 CHF	137.60%	1'376'000.00	0.13	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	1'500	0	0	1'500 CHF	106.05%	1'590'750.00	0.15	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	2'450	45	450	2'045 CHF	107.82%	2'204'919.00	0.21	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	1'500	0	0	1'500 CHF	103.80%	1'557'000.00	0.15	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	3'000	55	0	3'055 CHF	106.99%	3'268'544.50	0.31	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	1'500	50	0	1'550 CHF	109.25%	1'693'375.00	0.16	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLILJ 2 3/4 03/01/30	1'200	0	0	1'200 CHF	107.35%	1'288'200.00	0.12	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	1'870	0	0	1'870 CHF	103.05%	1'927'035.00	0.18	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	100.25%	3'007'500.00	0.28	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	1'500	0	0	1'500 CHF	104.10%	1'561'500.00	0.15	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	400	0	0	400 CHF	105.25%	421'000.00	0.04	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	2'500	0	0	2'500 CHF	104.15%	2'603'750.00	0.24	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2 7 04/21/27	1'500	0	0	1'500 CHF	102.90%	1'543'500.00	0.14	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	2'000	0	0	2'000 CHF	108.65%	2'173'000.00	0.20	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	825	0	825	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924446	3.0000 % REGEMM 3 04/16/27	1'000	0	0	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.10	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	1'000	0	0	1'000 CHF	105.25%	1'052'500.00	0.10	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	1'100	0	0	1'100 CHF	108.00%	1'188'000.00	0.11	a)
CH1258960603	0.0000 % SWNBK 0 01/22/24 26	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1258961080	0.0000 % SWNBK 0 08/26/24 84	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887436	2.9500 % SPIMAE 2.95 07/13/26	1'250	0	625	625 CHF	96.85%	605'312.50	0.06	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	1'250	0	1'250 CHF	115.70%	1'446'250.00	0.14	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	1'000	0	0	1'000 CHF	101.75%	1'017'500.00	0.10	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	1'000	5	0	1'005 CHF	110.55%	1'111'027.50	0.10	a)
CH1266847172	2.4000 % KENOVA 2.4 07/19/38	1'250	0	0	1'250 CHF	113.00%	1'412'500.00	0.13	a)
CH1266847180	1.7000 % EGW 1.7 07/20/43 69	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	2'000	2'580	0	4'580 CHF	107.07%	4'903'806.00	0.46	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	1'500	0	0	1'500 CHF	101.35%	1'520'250.00	0.14	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	940	0	0	940 CHF	111.50%	1'048'100.00	0.10	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	0	1'000	0	1'000 CHF	109.30%	1'093'000.00	0.10	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	1'500	0	0	1'500 CHF	114.01%	1'710'150.00	0.16	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	3'000	0	0	3'000 CHF	120.65%	3'619'500.00	0.34	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	1'250	0	0	1'250 CHF	101.41%	1'267'625.00	0.12	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	2'000	135	0	2'135 CHF	106.15%	2'266'302.50	0.21	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	1'050	0	0	1'050 CHF	114.75%	1'204'875.00	0.11	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	2'000	0	0	2'000 CHF	113.21%	2'264'200.00	0.21	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	2'055	0	2'055 CHF	106.42%	2'186'931.00	0.21	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	1'000	0	1'000 CHF	116.85%	1'168'500.00	0.11	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	2'000	25	0	2'025 CHF	105.95%	2'145'487.50	0.20	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	1'500	0	0	1'500 CHF	105.90%	1'588'500.00	0.15	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	2'500	35	0	2'535 CHF	105.05%	2'663'017.50	0.25	a)
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	2'000	0	0	2'000 CHF	109.40%	2'188'000.00	0.21	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	1'500	20	0	1'520 CHF	103.45%	1'572'440.00	0.15	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	1'700	0	1'700 CHF	113.50%	1'929'500.00	0.18	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	820	820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	1'750	0	1'750 CHF	102.30%	1'790'250.00	0.17	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	0	1'500	0	1'500 CHF	106.60%	1'599'000.00	0.15	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	2'000	0	2'000 CHF	102.65%	2'053'000.00	0.19	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	2'050	0	2'050 CHF	106.90%	2'191'450.00	0.21	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	1'200	15	0	1'215 CHF	108.00%	1'312'200.00	0.12	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	1'580	0	1'580 CHF	107.40%	1'696'920.00	0.16	a)
CH1290991327	1.1250 % KBBL 1 1/8 08/29/34	0	1'000	0	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	0.09	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	1'500	0	1'500 CHF	102.45%	1'536'750.00	0.14	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	0	2'055	0	2'055 CHF	107.60%	2'211'180.00	0.21	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	1'315	0	1'315 CHF	110.45%	1'452'417.50	0.14	a)
CH1296291037	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	2'500	0	2'500 CHF	107.45%	2'686'250.00	0.25	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	0	2'040	0	2'040 CHF	112.65%	2'298'060.00	0.22	a)
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	0	1'500	0	1'500 CHF	109.00%	1'635'000.00	0.15	a)
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	0	1'500	0	1'500 CHF	107.40%	1'611'000.00	0.15	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	1'000	0	1'000 CHF	103.20%	1'032'000.00	0.10	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	815	0	815 CHF	107.50%	876'125.00	0.08	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	1'260	0	1'260 CHF	108.85%	1'371'510.00	0.13	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	1'500	0	1'500 CHF	109.05%	1'635'750.00	0.15	a)
CH1305916855	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117024	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 NOV	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	0	2'025	0	2'025 CHF	105.50%	2'136'375.00	0.20	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	2'520	0	2'520 CHF	102.87%	2'592'324.00	0.24	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	935	0	935 CHF	108.90%	1'018'215.00	0.10	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	500	0	500 CHF	115.40%	577'000.00	0.05	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLLIL 2 3/8 12/05/29	0	1'160	0	1'160 CHF	105.30%	1'221'480.00	0.11	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	0	2'055	0	2'055 CHF	105.39%	2'165'764.50	0.20	a)
CH1310346254	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 JAN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	1'150	0	1'150 CHF	103.80%	1'193'700.00	0.11	a)
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	0	1'500	0	1'500 CHF	101.75%	1'526'250.00	0.14	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	1'385	0	1'385 CHF	103.10%	1'427'935.00	0.13	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	665	0	665 CHF	104.45%	694'592.50	0.07	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	1'020	0	1'020 CHF	101.80%	1'038'360.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	1'100	0	1'100 CHF	105.05%	1'155'550.00	0.11	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	555	0	555 CHF	104.20%	578'310.00	0.05	a)
CH1319968611	1.4000 % PFZENT 1.4 11/06/34 590	0	1'000	0	1'000 CHF	103.31%	1'033'100.00	0.10	a)
CH1319968629	1.4000 % PFZENT 1.4 03/15/38 591	0	1'000	0	1'000 CHF	104.35%	1'043'500.00	0.10	a)
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	0	2'000	0	2'000 CHF	105.57%	2'111'400.00	0.20	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	2'190	0	2'190 CHF	104.70%	2'292'930.00	0.22	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	0	1'500	0	1'500 CHF	103.00%	1'545'000.00	0.14	a)
CH1325037021	1.7000 % DAESW 1.7 10/30/29	0	1'000	0	1'000 CHF	101.75%	1'017'500.00	0.10	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	1'500	0	1'500 CHF	101.35%	1'520'250.00	0.14	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	1'000	0	1'000 CHF	104.40%	1'044'000.00	0.10	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	690	0	690 CHF	124.55%	859'395.00	0.08	a)
CH1331113501	2.3750 % CLNVX 2 3/8 03/30/27	0	1'500	0	1'500 CHF	102.20%	1'533'000.00	0.14	a)
CH1337248962	1.6500 % PSPNSW 1.65 10/11/32	0	1'525	0	1'525 CHF	101.70%	1'550'925.00	0.15	a)
CH1337248988	2.1175 % RAIFFS 2.1175 05/14/32	0	700	0	700 CHF	103.15%	722'050.00	0.07	a)
CH1337249010	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 MAY	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	845	0	845 CHF	102.45%	865'702.50	0.08	a)
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	0	100	0	100 CHF	102.80%	102'800.00	0.01	a)
CH1344316778	1.7500 % NESNVX 1 3/4 05/30/40	0	1'530	0	1'530 CHF	107.00%	1'637'100.00	0.15	a)
CH1346742914	2.4000 % SGKNSW 2.4 05/30/34	0	1'300	0	1'300 CHF	105.00%	1'365'000.00	0.13	a)
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	0	1'015	0	1'015 CHF	105.10%	1'066'765.00	0.10	a)
CH1346742963	2.1000 % LUZKAN 2.1 06/21/34	0	2'000	0	2'000 CHF	104.90%	2'098'000.00	0.20	a)
CH1346742989	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 594	0	3'000	0	3'000 CHF	103.74%	3'112'200.00	0.29	a)
CH1346743011	1.8500 % WASSER 1.85 07/01/38	0	1'000	0	1'000 CHF	107.45%	1'074'500.00	0.10	a)
CH1346743052	1.3000 % ZURICH 1.3 06/24/37	0	2'000	0	2'000 CHF	106.05%	2'121'000.00	0.20	a)
CH1346743078	1.8500 % COOPSW 1.85 07/16/32	0	1'500	0	1'500 CHF	103.95%	1'559'250.00	0.15	a)
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	0	1'500	0	1'500 CHF	101.10%	1'516'500.00	0.14	a)
CH1348614046	1.8000 % BARY 1.8 05/15/26	0	1'750	0	1'750 CHF	100.70%	1'762'250.00	0.17	a)
CH1348614061	2.4000 % BARY 2.4 05/17/34	0	1'250	0	1'250 CHF	104.95%	1'311'875.00	0.12	a)
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	0	1'515	0	1'515 CHF	104.40%	1'581'660.00	0.15	a)
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	102.45%	2'049'000.00	0.19	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMNVX 1.8 08/23/34	0	1'580	0	1'580 CHF	105.35%	1'664'530.00	0.16	a)
CH1350727801	2.0000 % SCMNVX 2 11/23/39	0	2'040	0	2'040 CHF	107.95%	2'202'180.00	0.21	a)
CH1353015022	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 07/24/37 757	0	1'500	0	1'500 CHF	103.40%	1'551'000.00	0.15	a)
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.05%	1'530'750.00	0.14	a)
CH1353257848	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/49	0	2'000	0	2'000 CHF	114.15%	2'283'000.00	0.21	a)
CH1353257863	1.9500 % HELNSW 1.95 06/26/34	0	1'500	0	1'500 CHF	105.35%	1'580'250.00	0.15	a)
CH1353257913	1.9950 % EFGBNK 1.995 06/28/27	0	2'000	0	2'000 CHF	101.40%	2'028'000.00	0.19	a)
CH1353257939	1.6250 % KWOPER 1 5/8 07/16/32	0	1'500	0	1'500 CHF	103.10%	1'546'500.00	0.15	a)
CH1357852651	1.6925 % SRAIL 1.6925 07/12/29	0	1'500	0	1'500 CHF	101.35%	1'520'250.00	0.14	a)
CH1357852693	1.6500 % SPSNSW 1.65 07/16/29	0	1'500	0	1'500 CHF	101.10%	1'516'500.00	0.14	a)
CH1361401743	1.4000 % IWBBAS 1.4 07/13/34	0	250	0	250 CHF	102.20%	255'500.00	0.02	a)
CH1361401792	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 AUG	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401800	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 AUG	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401842	1.1250 % ZKB 1 1/8 08/16/34 158	0	2'000	0	2'000 CHF	100.20%	2'004'000.00	0.19	a)
CH1361401883	1.1250 % GEBNVX 1 1/8 09/10/31	0	1'930	0	1'930 CHF	100.20%	1'933'821.40	0.18	a)
CH1361401891	1.5606 % BCHNSW 1.5606 09/29/28	0	1'245	0	1'245 CHF	99.93%	1'244'178.30	0.12	a)
CH1366517105	1.1300 % THURBK 1.13 08/29/44	0	2'000	0	2'000 CHF	100.60%	2'012'000.00	0.19	a)
CH1371736765	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 12/23/39 760	0	2'000	0	2'000 CHF	100.91%	2'018'200.00	0.19	a)
CH1371736815	1.0975 % ROSW 1.0975 09/06/34	0	2'000	0	2'000 CHF	99.65%	1'993'020.00	0.19	a)
CH1373904387	1.3000 % KENOVA 1.3 09/26/34	0	1'500	0	1'500 CHF	99.91%	1'498'650.00	0.14	a)
CH1373904411	1.9000 % GALDSW 1.9 09/27/32	0	1'170	0	1'170 CHF	100.35%	1'174'106.70	0.11	a)
CH1373904429	1.5000 % UNIZUE 1 1/2 09/27/32	0	1'700	0	1'700 CHF	100.30%	1'705'100.00	0.16	a)
<b>CH</b>							<b>758'818'140.10</b>	<b>71.21</b>	
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122789	1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	97.15%	3'108'800.00	0.29	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	6'200	20	1'200	5'020 CHF	97.62%	4'900'574.20	0.46	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'500	20	0	1'520 CHF	104.60%	1'589'920.00	0.15	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	1'500	25	0	1'525 CHF	101.02%	1'540'555.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	2'500	0	2'500 CHF	103.45%	2'586'250.00	0.24	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	101.95%	1'554'737.50	0.15	a)
CH1335850306	2.8000 % UINT 2.8 07/23/27	0	1'500	0	1'500 CHF	101.10%	1'516'500.00	0.14	a)
CH1348614160	2.0975 % AGUAND 2.0975 05/30/29	0	2'025	0	2'025 CHF	101.50%	2'055'375.00	0.19	a)
CH1377443812	2.1275 % ECLCI 2.1275 09/26/29	0	1'500	0	1'500 CHF	99.96%	1'499'385.00	0.14	a)
<b>CL</b>							<b>20'352'096.70</b>	<b>1.91</b>	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'180	0	2'180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	97.00%	1'552'000.00	0.15	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.80%	948'000.00	0.09	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	4'250	0	0	4'250 CHF	117.65%	5'000'125.00	0.47	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	103.40%	1'551'000.00	0.15	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.90%	2'158'000.00	0.20	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	2'400	0	0	2'400 CHF	108.85%	2'612'400.00	0.25	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	2'000	25	0	2'025 CHF	103.20%	2'089'800.00	0.20	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.95%	2'079'000.00	0.20	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	103.75%	1'556'250.00	0.15	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	1'770	0	1'770 CHF	105.70%	1'870'890.00	0.18	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.95%	1'544'250.00	0.14	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.90%	1'039'000.00	0.10	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	103.60%	2'590'000.00	0.24	a)
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.60%	1'524'000.00	0.14	a)
CH1357852735	1.4900 % HANWHA 1.49 08/06/27	0	1'100	0	1'100 CHF	100.75%	1'108'250.00	0.10	a)
CH1357852800	2.0000 % ANNGR 2 08/26/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.09	a)
<b>DE</b>							<b>30'230'465.00</b>	<b>2.84</b>	
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	0	2'525	0	2'525 CHF	104.70%	2'643'675.00	0.25	a)
<b>DK</b>							<b>2'643'675.00</b>	<b>0.25</b>	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	0	165	0	165 CHF	99.90%	164'835.00	0.02	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 CHF	99.25%	4'962'500.00	0.47	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'800	165	1'800	165 CHF	96.75%	159'637.50	0.01	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	2'000	25	0	2'025 CHF	101.50%	2'055'375.00	0.19	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.59%	1'523'850.00	0.14	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSFC 2.7325 07/04/25 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.05%	2'061'000.00	0.19	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	1'305	0	1'305 CHF	105.25%	1'373'512.50	0.13	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	103.30%	1'446'200.00	0.14	a)
CH1357852685	1.5625 % IBESM 1.5625 07/11/31 EMTN	0	1'845	0	1'845 CHF	101.05%	1'864'372.50	0.17	a)
<b>ES</b>							<b>15'611'282.50</b>	<b>1.46</b>	
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	104.45%	1'462'300.00	0.14	a)
<b>FI</b>							<b>1'462'300.00</b>	<b>0.14</b>	
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	100.33%	1'504'950.00	0.14	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	0	135	135	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	0	110	0	110 CHF	97.85%	107'635.00	0.01	a)
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	5'000	110	1'000	4'110 CHF	95.20%	3'912'720.00	0.37	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	0	155	0	155 CHF	96.45%	149'497.50	0.01	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	96.70%	4'835'000.00	0.45	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	5'000	220	1'220	4'000 CHF	96.20%	3'848'000.00	0.36	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	1'350	0	0	1'350 CHF	103.05%	1'391'175.00	0.13	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	2'500	65	1'065	1'500 CHF	106.00%	1'590'000.00	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'500	55	0	2'555 CHF	103.00%	2'631'650.00	0.25	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	2'000	80	0	2'080 CHF	103.50%	2'152'800.00	0.20	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	106.35%	1'063'500.00	0.10	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	4'100	25	2'100	2'025 CHF	102.95%	2'084'737.50	0.20	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	2'000	65	0	2'065 CHF	106.20%	2'193'030.00	0.21	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	2'000	30	0	2'030 CHF	107.40%	2'180'220.00	0.20	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'000	25	0	2'025 CHF	106.70%	2'160'675.00	0.20	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.05%	2'141'000.00	0.20	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	2'000	25	0	2'025 CHF	104.60%	2'118'150.00	0.20	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.50%	2'070'000.00	0.19	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	103.50%	1'449'000.00	0.14	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	102.65%	1'539'750.00	0.14	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	1'510	0	1'510 CHF	104.35%	1'575'685.00	0.15	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	1'570	0	1'570 CHF	106.20%	1'667'340.00	0.16	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	2'025	0	2'025 CHF	102.70%	2'079'675.00	0.20	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	104.80%	1'598'200.00	0.15	a)
CH1321508330	1.5000 % CDCEPS 1 1/2 05/24/39 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	104.90%	1'888'200.00	0.18	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	102.85%	1'337'050.00	0.13	a)
CH1335850298	1.4778 % AFLBNK 1.4778 04/20/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	102.80%	2'056'000.00	0.19	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	101.95%	1'554'737.50	0.15	a)
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	102.55%	1'563'887.50	0.15	a)
CH1356570312	1.7425 % EDF 1.7425 09/06/32 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	99.64%	1'494'585.00	0.14	a)
<b>FR</b>							<b>57'938'850.00</b>	<b>5.44</b>	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	3'800	0	1'800	2'000 CHF	94.25%	1'885'000.00	0.18	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	3'000	0	1'000	2'000 CHF	99.52%	1'990'400.00	0.19	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	3'200	230	700	2'730 CHF	102.10%	2'787'330.00	0.26	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	104.75%	1'676'000.00	0.16	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	2'500	35	0	2'535 CHF	105.20%	2'666'820.00	0.25	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	105.45%	1'265'400.00	0.12	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	2'500	55	0	2'555 CHF	102.55%	2'620'152.50	0.25	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	102.80%	1'644'800.00	0.15	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.00%	2'040'000.00	0.19	a)
<b>GB</b>							<b>18'575'902.50</b>	<b>1.74</b>	
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>JE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	3'250	25	0	3'275 CHF	101.13%	3'312'007.50	0.31	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	102.50%	1'281'250.00	0.12	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	1'600	25	0	1'625 CHF	101.12%	1'643'200.00	0.15	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.13%	1'516'950.00	0.14	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	100.85%	1'537'962.50	0.14	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	1'460	0	1'460 CHF	103.70%	1'514'020.00	0.14	a)
<b>KR</b>							<b>10'805'390.00</b>	<b>1.01</b>	
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	6'400	0	6'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>KY</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	1'000	0	1'000 CHF	105.75%	1'057'500.00	0.10	a)
CH1323274055	2.0000 % LGT 2 02/15/34 EMTN	0	2'025	0	2'025 CHF	105.35%	2'133'337.50	0.20	a)
<b>LI</b>							<b>3'190'837.50</b>	<b>0.30</b>	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	1'500	0	500	1'000 CHF	99.23%	992'300.00	0.09	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.80%	1'542'000.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.35%	2'067'000.00	0.19	a)
<b>LU</b>							<b>4'601'300.00</b>	<b>0.43</b>	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	2'000	0	0	2'000 CHF	94.45%	1'889'000.00	0.18	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	800	0	0	800 CHF	103.20%	825'600.00	0.08	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	1'850	25	0	1'875 CHF	103.35%	1'937'812.50	0.18	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	1'830	20	0	1'850 CHF	102.85%	1'902'725.00	0.18	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	102.55%	1'333'150.00	0.13	a)
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	104.50%	1'567'500.00	0.15	a)
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	0	1'155	0	1'155 CHF	104.60%	1'208'130.00	0.11	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.75%	1'526'250.00	0.14	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	0	2'050	0	2'050 CHF	104.30%	2'138'150.00	0.20	a)
<b>NL</b>							<b>14'328'317.50</b>	<b>1.34</b>	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	3'600	70	1'850	1'820 CHF	100.00%	1'820'000.00	0.17	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	103.90%	1'662'400.00	0.16	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	2'000	25	0	2'025 CHF	104.90%	2'124'225.00	0.20	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.45%	1'434'300.00	0.13	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	2'035	0	2'035 CHF	103.50%	2'106'225.00	0.20	a)
CH1371736781	1.2925 % DNBNO 1.2925 03/05/31 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	99.97%	1'599'520.00	0.15	a)
<b>NO</b>							<b>10'746'670.00</b>	<b>1.01</b>	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	7'500	145	4'645	3'000 CHF	95.60%	2'868'000.00	0.27	a)
<b>NZ</b>							<b>2'868'000.00</b>	<b>0.27</b>	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	105.00%	1'680'000.00	0.16	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	107.70%	1'615'500.00	0.15	a)
CH1331113576	2.0105 % SWEDA 2.0105 10/10/30	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>SE</b>							<b>3'295'500.00</b>	<b>0.31</b>	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>SG</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1344316703	1.9150 % SLOVAK 1.915 05/10/34 10Y	0	2'040	0	2'040 CHF	103.65%	2'114'460.00	0.20	a)
<b>SK</b>							<b>2'114'460.00</b>	<b>0.20</b>	
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'000	180	680	1'500 CHF	99.29%	1'489'350.00	0.14	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	2'370	220	2'590	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	4'100	75	1'100	3'075 CHF	94.80%	2'915'100.00	0.27	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	2'500	140	500	2'140 CHF	94.10%	2'013'740.00	0.19	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	6'000	0	2'000	4'000 CHF	95.05%	3'802'000.00	0.36	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	8'000	25	5'025	3'000 CHF	96.10%	2'883'000.00	0.27	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	6'210	55	3'265	3'000 CHF	102.35%	3'070'500.00	0.29	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	1'500	15	0	1'515 CHF	105.00%	1'590'750.00	0.15	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	1'400	0	0	1'400 CHF	105.15%	1'472'100.00	0.14	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	0	1'100	0	1'100 CHF	103.65%	1'140'150.00	0.11	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	2'000	0	2'000 CHF	106.05%	2'121'000.00	0.20	a)
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	0	420	0	420 CHF	99.94%	419'748.00	0.04	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	104.35%	1'591'337.50	0.15	a)
<b>US</b>							<b>24'508'775.50</b>	<b>2.30</b>	
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1135555576	0.1700 % CABEL 0.17 09/29/31 EMTN	6'000	110	1'110	5'000 CHF	90.25%	4'512'500.00	0.42	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	6'000	110	1'610	4'500 CHF	97.75%	4'398'750.00	0.41	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEL 1.5462 11/30/26 EMTN	4'750	40	750	4'040 CHF	100.65%	4'066'260.00	0.38	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	2'000	35	0	2'035 CHF	104.33%	2'123'115.50	0.20	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	2'500	25	0	2'525 CHF	104.15%	2'629'787.50	0.25	a)
CH1271360575	1.7500 % AIB 1 3/4 06/26/30	2'500	55	500	2'055 CHF	104.70%	2'151'585.00	0.20	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	1'500	65	0	1'565 CHF	106.25%	1'662'812.50	0.16	a)
CH1335850280	1.1525 % NIB 1.1525 05/02/31 EMTN	0	1'525	0	1'525 CHF	102.50%	1'563'125.00	0.15	a)
<b>XS</b>							<b>23'107'935.50</b>	<b>2.17</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'586'232.28	0.34
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'053'285'317.80	98.84
Sonstige Vermögenswerte	8'801'923.74	0.83
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'065'673'473.82</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-43'128.61	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'065'630'345.21</b>	

## 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);	1'053'285'317.80	98.84
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2023 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
A	CHF	0.30	-	0.30	-
B	CHF	0.30	-	0.30	-
It	CHF	0.30	-	0.30	-
Nt	CHF	0.30	-	0.30	-

## 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 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.09.2023 - 31.08.2024

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % Max
A	0.600	1.000	-
B	0.600	1.000	-
It	0.190	0.400	-
Nt	0.030	0.200	-

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

## 8 Benchmark

Swiss Bond Index (SBI) ® AAA-BBB 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: 03.12.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Nein	CHF	0.60000	0.21000	0.39000

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Nein	CHF	0.62679	0.21937	0.40742
It	Nein	CHF	1.059	0.370	0.689
Nt	Nein	CHF	1.228	0.429	0.799

## 12 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$



## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit 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 Konstanthaltung 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.

Er wird auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Der Besondere Teil kann für einzelne Rechnungseinheiten bzw. Referenzwährungen abweichende Rundungsbestimmungen vorsehen.

7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse

bestimmt.

Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
- b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.