

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 1-5 CHF

Halbjahresbericht per 31.07.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	21580388	CHF
FA CHF	21580386	CHF
GT CHF	33099914	CHF
NT CHF	21580389	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	25
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	25
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	25
7	Pauschale Verwaltungskommission	26
8	Benchmark	26
9	TER	26
10	Fussnoten	27
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	28

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	01.02.2024	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021
	bis	31.07.2024	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'640'054'772.93	2'474'193'344.20	2'314'393'221.36	2'073'935'353.19
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		117'646'071.67	206'805'953.28	220'492'119.50	196'884'697.89
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'236'152.770	2'203'314.560	2'402'699.628	2'056'323.507
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.1711	93.8613	91.7685	95.7460
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		99.9154	100.7271	91.9703	91.7364
Thesaurierung je Anteil		-	0.83	0.63	0.72
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		178'159'255.45	177'723'375.71	105'009'316.91	32'536'170.09
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'018'121.312	2'028'969.617	1'219'883.235	360'781.106
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		88.2798	87.5929	86.0814	90.1826
Ausschüttung je Anteil		-	0.80	0.65	0.60
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		864'160'911.23	794'298'132.02	798'743'891.12	635'057'215.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'976'422.595	8'366'258.873	8'606'625.635	6'559'856.707
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.2701	94.9407	92.8057	96.8096
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		101.0691	101.8854	93.0097	92.7555
Thesaurierung je Anteil		-	0.86	0.66	0.76
Total Expense Ratio (TER)		0.13 %	0.13 %	0.13 %	0.13 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'480'088'534.58	1'295'365'883.19	1'190'147'893.83	1'209'457'270.02
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		15'293'521.997	13'574'993.377	12'770'054.553	12'450'838.687
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.7788	95.4229	93.1983	97.1386
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		101.6032	102.4029	93.4033	93.0707
Thesaurierung je Anteil		-	0.99	0.79	0.89
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	1.71 %	3.24 %	-5.25 %	-0.60 %
Klasse FA CHF	1.71 %	3.25 %	-5.25 %	-0.60 %
Klasse GT CHF	1.72 %	3.28 %	-5.22 %	-0.57 %
Klasse NT CHF	1.79 %	3.41 %	-5.10 %	-0.44 %
Benchmark	1.75 %	3.44 %	-5.37 %	-0.42 %
Tracking Error 33)	-	0.09 %	0.20 %	0.05 %

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 DT CHF	-0.04 %
Klasse FA CHF	-0.04 %
Klasse GT CHF	-0.03 %
Klasse NT CHF	0.04 %

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)	31.07.2024	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	5'246'600.35	10'500'888.51
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'617'958'167.35	2'446'249'130.95
Sonstige Vermögenswerte	16'992'750.63	17'591'750.33
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'640'197'518.33	2'474'341'769.79
Andere Verbindlichkeiten	-142'745.40	-148'425.59
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'640'054'772.93	2'474'193'344.20

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'203'314.560	2'402'699.628
Ausgegebene Anteile		79'778.782	579'005.205
Zurückgenommene Anteile		-1'046'940.572	-778'390.273
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'236'152.770	2'203'314.560

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'028'969.617	1'219'883.235
Ausgegebene Anteile		195'067.056	1'004'637.862
Zurückgenommene Anteile		-205'915.361	-195'551.480
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'018'121.312	2'028'969.617

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'366'258.873	8'606'625.635
Ausgegebene Anteile		1'849'809.785	1'699'642.376
Zurückgenommene Anteile		-1'239'646.063	-1'940'009.138
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'976'422.595	8'366'258.873

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		13'574'993.377	12'770'054.553
Ausgegebene Anteile		2'072'510.267	5'098'093.868
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		273'132.187	443'921.790
Zurückgenommene Anteile		-495'393.834	-3'265'889.225
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-131'720.000	-1'471'187.609
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		15'293'521.997	13'574'993.377

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	09.04.2024	17'895'458.93	186'472.411
Klasse NT CHF	16.07.2024	8'359'236.66	86'659.776

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	08.03.2024	12'615'456.66	131'720.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		2'474'193'344.20	2'314'393'221.36
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'607'321.62	-1'023'028.78
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-8'155'708.95	-6'438'652.20
Saldo aus dem Anteilverkehr		130'806'545.72	103'988'162.28
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		44'817'913.58	63'273'641.54
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'640'054'772.93	2'474'193'344.20

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		58'006.56	52'973.71
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		14'499'600.54	25'888'272.32
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'205'249.66	4'376'430.40
Total Ertrag		15'762'856.76	30'317'676.43
Aufwand			
Passivzinsen		-0.05	0.00
Reglementarische Vergütungen		-784'801.21	-1'643'233.36
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-580'376.05	-4'489'130.69
Total Aufwand		-1'365'177.31	-6'132'364.05
Nettoertrag / Verlust			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-13'449'489.96	-35'147'224.84
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		970'257.21	1'576'030.02
Realisierter Erfolg		1'918'446.70	-9'385'882.44
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		42'899'466.88	72'659'523.98
Gesamterfolg		44'817'913.58	63'273'641.54

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							2'617'958'167.35	99.16	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							2'617'958'167.35	99.16	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	6'456	2'000	250	62'206 CHF	112.45%	69'950'647.00	2.65	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	6'065	0	6'065	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	3'225	0	3'225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	6'430	0	6'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	10'990	0	0	10'990 CHF	101.54%	11'159'246.00	0.42	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'760	0	120	2'640 CHF	101.68%	2'684'352.00	0.10	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	1'000	400	0	1'400 CHF	102.20%	1'430'800.00	0.05	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	9'920	900	100	10'720 CHF	103.45%	11'089'840.00	0.42	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'015	0	0	2'015 CHF	101.90%	2'053'285.00	0.08	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	1'110	0	0	1'110 CHF	101.74%	1'129'314.00	0.04	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	4'860	0	100	4'760 CHF	104.15%	4'957'540.00	0.19	a)
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	4'010	0	0	4'010 CHF	106.27%	4'261'427.00	0.16	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	34'316	2'620	2'700	34'236 CHF	107.63%	36'848'206.80	1.40	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	0	2'100	0	2'100 CHF	108.00%	2'268'000.00	0.09	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	3'150	0	3'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	2'720	0	2'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	2'685	0	0	2'685 CHF	100.80%	2'706'480.00	0.10	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	3'800	0	0	3'800 CHF	105.05%	3'991'900.00	0.15	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	5'360	0	0	5'360 CHF	100.91%	5'408'776.00	0.20	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	1'660	260	130	1'790 CHF	101.60%	1'818'640.00	0.07	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	101.95%	2'140'950.00	0.08	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	5'860	0	0	5'860 CHF	101.15%	5'927'390.00	0.22	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	2'400	500	0	2'900 CHF	104.90%	3'042'100.00	0.12	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	6'600	1'300	0	7'900 CHF	104.71%	8'272'090.00	0.31	a)
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	1'080	0	0	1'080 CHF	101.85%	1'099'980.00	0.04	a)
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	4'700	3'400	600	7'500 CHF	103.67%	7'775'250.00	0.29	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.73%	1'525'950.00	0.06	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	2'170	0	0	2'170 CHF	102.20%	2'217'740.00	0.08	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	4'730	0	0	4'730 CHF	102.36%	4'841'628.00	0.18	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	2'400	0	0	2'400 CHF	102.20%	2'452'800.00	0.09	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	4'210	0	0	4'210 CHF	102.16%	4'300'936.00	0.16	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	0	1'000	0	1'000 CHF	108.25%	1'082'500.00	0.04	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	5'615	0	750	4'865 CHF	104.00%	5'059'600.00	0.19	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	2'730	0	2'730	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	1'570	0	0	1'570 CHF	101.75%	1'597'475.00	0.06	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	5'580	500	500	5'580 CHF	101.47%	5'662'026.00	0.21	a)
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'675	0	0	1'675 CHF	100.72%	1'687'060.00	0.06	a)
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	2'300	0	0	2'300 CHF	102.00%	2'346'000.00	0.09	a)
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	1'600	0	0	1'600 CHF	100.75%	1'612'000.00	0.06	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	2'200	0	0	2'200 CHF	100.90%	2'219'800.00	0.08	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	5'670	7'300	0	12'970 CHF	101.64%	13'182'708.00	0.50	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	3'300	0	0	3'300 CHF	100.95%	3'331'350.00	0.13	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	3'345	0	0	3'345 CHF	101.15%	3'383'467.50	0.13	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	8'765	500	1'500	7'765 CHF	100.89%	7'834'108.50	0.30	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'880	0	140	1'740 CHF	101.05%	1'758'270.00	0.07	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	7'160	0	0	7'160 CHF	102.18%	7'316'088.00	0.28	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	9'470	250	900	8'820 CHF	101.28%	8'932'896.00	0.34	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	36'200	0	28'000	8'200 CHF	100.61%	8'250'020.00	0.31	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	2'700	0	0	2'700 CHF	101.60%	2'743'200.00	0.10	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	0	7'000	0	7'000 CHF	102.23%	7'156'100.00	0.27	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	2'200	0	0	2'200 CHF	100.80%	2'217'600.00	0.08	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'500	0	0	1'500 CHF	101.15%	1'517'250.00	0.06	a)
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	101.30%	2'431'200.00	0.09	a)
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	2'000	0	0	2'000 CHF	100.80%	2'016'000.00	0.08	a)
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	2'150	0	0	2'150 CHF	101.20%	2'175'800.00	0.08	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	6'130	0	1'600	4'530 CHF	101.05%	4'577'565.00	0.17	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	1'600	0	0	1'600 CHF	101.05%	1'616'800.00	0.06	a)
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	1'000	600	0	1'600 CHF	100.65%	1'610'400.00	0.06	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	1'750	0	100	1'650 CHF	100.06%	1'650'990.00	0.06	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'990	500	0	2'490 CHF	100.75%	2'508'675.00	0.10	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	3'080	0	0	3'080 CHF	103.65%	3'192'420.00	0.12	a)
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	1'470	0	1'470	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	3'530	0	0	3'530 CHF	101.10%	3'568'830.00	0.14	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	8'360	0	120	8'240 CHF	101.15%	8'334'760.00	0.32	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	2'330	700	0	3'030 CHF	101.95%	3'089'085.00	0.12	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	0	2'000	0	2'000 CHF	103.05%	2'061'000.00	0.08	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	1'950	200	0	2'150 CHF	102.15%	2'196'225.00	0.08	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	2'310	1'500	0	3'810 CHF	101.00%	3'848'100.00	0.15	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	1'450	300	0	1'750 CHF	101.80%	1'781'500.00	0.07	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	0	1'250	0	1'250 CHF	102.00%	1'275'000.00	0.05	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	2'575	0	2'575	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	3'250	0	0	3'250 CHF	102.50%	3'331'250.00	0.13	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	3'865	1'000	0	4'865 CHF	101.81%	4'953'056.50	0.19	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	1'400	400	0	1'800 CHF	103.40%	1'861'200.00	0.07	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	8'800	0	0	8'800 CHF	100.62%	8'854'560.00	0.34	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	2'580	0	0	2'580 CHF	103.50%	2'670'300.00	0.10	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'335	0	0	1'335 CHF	101.45%	1'354'357.50	0.05	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	3'290	0	0	3'290 CHF	101.05%	3'324'545.00	0.13	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	640	1'500	0	2'140 CHF	101.60%	2'174'240.00	0.08	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	40'652	3'120	1'738	42'034 CHF	101.08%	42'487'967.20	1.61	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	0	58'150	0	58'150 CHF	97.38%	56'626'470.00	2.14	a)
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	990	0	0	990 CHF	100.65%	996'435.00	0.04	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228531437	2.3750 % KWLIIJ 2 3/8 12/10/26	1'900	0	0	1'900 CHF	102.35%	1'944'650.00	0.07	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	3'450	0	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	8'300	750	0	9'050 CHF	101.07%	9'146'835.00	0.35	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	0	2'100	0	2'100 CHF	104.00%	2'184'000.00	0.08	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	1'850	0	200	1'650 CHF	100.55%	1'659'075.00	0.06	a)
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	6'310	0	0	6'310 CHF	100.60%	6'347'860.00	0.24	a)
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	0	1'320	0	1'320 CHF	102.55%	1'353'660.00	0.05	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	0	5'500	0	5'500 CHF	102.10%	5'615'500.00	0.21	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'640	0	0	1'640 CHF	100.70%	1'651'480.00	0.06	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMNvx 1 1/2 07/14/26	2'950	0	100	2'850 CHF	100.80%	2'872'800.00	0.11	a)
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	700	300	0	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	0.04	a)
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	3'040	0	0	3'040 CHF	100.35%	3'050'640.00	0.12	a)
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	1'580	0	0	1'580 CHF	99.70%	1'575'260.00	0.06	a)
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	100.35%	2'759'625.00	0.10	a)
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'870	0	0	1'870 CHF	100.35%	1'876'545.00	0.07	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	1'980	0	0	1'980 CHF	100.45%	1'988'910.00	0.08	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	4'220	0	0	4'220 CHF	99.92%	4'216'624.00	0.16	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	98.50%	2'167'000.00	0.08	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	1'115	0	1'115	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	2'215	0	2'215	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	2'555	0	100	2'455 CHF	99.25%	2'436'587.50	0.09	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	2'170	0	2'170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	9'950	2'500	0	12'450 CHF	99.90%	12'437'550.00	0.47	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	10'050	0	10'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	650	0	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	2'400	0	0	2'400 CHF	98.75%	2'370'000.00	0.09	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	2'820	0	0	2'820 CHF	98.05%	2'765'010.00	0.10	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	1'700	0	0	1'700 CHF	97.95%	1'665'150.00	0.06	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	0	2'200	0	2'200 CHF	97.10%	2'136'200.00	0.08	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	3'730	0	100	3'630 CHF	97.75%	3'548'325.00	0.13	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	5'160	0	5'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	98.55%	3'153'600.00	0.12	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	9'870	0	0	9'870 CHF	98.11%	9'683'457.00	0.37	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	1'510	0	1'510	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	2'500	0	0	2'500 CHF	98.30%	2'457'500.00	0.09	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	11'030	0	11'030	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	0	9'000	0	9'000 CHF	98.10%	8'829'000.00	0.33	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27	2'450	0	0	2'450 CHF	98.45%	2'412'025.00	0.09	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	2'900	0	0	2'900 CHF	98.70%	2'862'300.00	0.11	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	2'280	1'000	1'300	1'980 CHF	99.82%	1'976'436.00	0.07	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	2'550	0	0	2'550 CHF	98.10%	2'501'550.00	0.09	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	0	500	0	500 CHF	97.80%	489'000.00	0.02	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	1'825	0	1'825	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	98.55%	1'971'000.00	0.07	a)
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	1'540	0	1'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	5'050	0	5'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	3'770	0	3'770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	8'850	0	8'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	2'240	0	500	1'740 CHF	99.52%	1'731'648.00	0.07	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	99.00%	1'584'000.00	0.06	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	11'840	1'170	1'150	11'860 CHF	98.83%	11'721'238.00	0.44	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	2'200	0	0	2'200 CHF	99.58%	2'190'760.00	0.08	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	10'040	0	5'000	5'040 CHF	99.45%	5'012'280.00	0.19	a)
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	1'250	0	0	1'250 CHF	99.48%	1'243'500.00	0.05	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	7'280	600	0	7'880 CHF	99.01%	7'801'988.00	0.30	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	5'350	350	100	5'600 CHF	99.50%	5'572'000.00	0.21	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	100.70%	1'208'400.00	0.05	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	1'900	0	0	1'900 CHF	99.05%	1'881'950.00	0.07	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	6'150	0	0	6'150 CHF	99.30%	6'106'950.00	0.23	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	8'230	0	500	7'730 CHF	99.19%	7'667'387.00	0.29	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	1'830	4'950	180	6'600 CHF	100.40%	6'626'400.00	0.25	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	3'740	0	0	3'740 CHF	99.33%	3'714'942.00	0.14	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'820	0	300	2'520 CHF	98.84%	2'490'768.00	0.09	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	0	5'900	0	5'900 CHF	97.56%	5'756'040.00	0.22	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'510	0	0	1'510 CHF	98.79%	1'491'729.00	0.06	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	2'630	0	0	2'630 CHF	97.90%	2'574'770.00	0.10	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	98.15%	2'061'150.00	0.08	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	98.62%	3'353'080.00	0.13	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	490	1'700	0	2'190 CHF	100.20%	2'194'380.00	0.08	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	1'080	200	0	1'280 CHF	97.80%	1'251'840.00	0.05	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	5'850	0	500	5'350 CHF	98.58%	5'274'030.00	0.20	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	1'600	0	0	1'600 CHF	99.80%	1'596'800.00	0.06	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	3'065	0	0	3'065 CHF	101.05%	3'097'182.50	0.12	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	11'125	0	150	10'975 CHF	97.31%	10'679'772.50	0.40	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	1'140	0	120	10'020 CHF	98.45%	9'864'690.00	0.37	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	98.51%	1'576'160.00	0.06	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	1'200	0	0	1'200 CHF	99.95%	1'199'400.00	0.05	a)
CH0310646523	0.5000 % KBRFB 0 1/2 02/23/28	1'950	1'100	0	3'050 CHF	97.70%	2'979'850.00	0.11	a)
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	780	220	0	1'000 CHF	97.20%	972'000.00	0.04	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0313130061	0.2500 % KBSCSW 0 1/4 02/19/26	1'500	0	0	1'500 CHF	98.60%	1'479'000.00	0.06	a)
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	680	0	0	680 CHF	97.90%	665'720.00	0.03	a)
CH0317921663	0.3750 % SCMNFX 0 3/8 03/31/28	1'190	2'100	0	3'290 CHF	97.55%	3'209'395.00	0.12	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	10'045	500	800	9'745 CHF	97.83%	9'533'533.50	0.36	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	3'810	0	100	3'710 CHF	98.10%	3'639'510.00	0.14	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	1'600	0	0	1'600 CHF	98.20%	1'571'200.00	0.06	a)
CH0319403777	0.3750 % PPSNSW 0 3/8 04/29/26	1'450	0	0	1'450 CHF	98.40%	1'426'800.00	0.05	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	9'700	1'000	0	10'700 CHF	96.44%	10'319'080.00	0.39	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	1'900	0	0	1'900 CHF	99.40%	1'888'600.00	0.07	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	3'620	400	0	4'020 CHF	98.80%	3'971'760.00	0.15	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	98.40%	1'771'200.00	0.07	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	250	0	0	250 CHF	97.80%	244'500.00	0.01	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	3'580	0	3'580	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	6'385	750	0	7'135 CHF	97.05%	6'924'517.50	0.26	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'165	0	0	1'165 CHF	97.00%	1'130'050.00	0.04	a)
CH0326213912	0.2500 % KISPZ 0 1/4 07/28/28	0	2'000	0	2'000 CHF	95.85%	1'917'000.00	0.07	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	820	0	0	820 CHF	98.00%	803'600.00	0.03	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	0	750	0	750 CHF	95.90%	719'250.00	0.03	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	4'610	0	0	4'610 CHF	96.85%	4'464'785.00	0.17	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.87%	988'700.00	0.04	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	790	0	180	610 CHF	98.20%	599'020.00	0.02	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	650	0	0	650 CHF	97.70%	635'050.00	0.02	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	8'965	500	750	8'715 CHF	97.48%	8'495'382.00	0.32	a)
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	2'480	0	0	2'480 CHF	98.96%	2'454'208.00	0.09	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	5'435	0	650	4'785 CHF	97.81%	4'680'208.50	0.18	a)
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	3'290	0	100	3'190 CHF	97.85%	3'121'415.00	0.12	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCSW 0.1 10/25/28	0	1'000	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.04	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	98.60%	1'084'600.00	0.04	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	1'500	120	1'380 CHF	97.30%	1'342'740.00	0.05	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	3'320	0	0	3'320 CHF	97.55%	3'238'660.00	0.12	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	8'555	0	8'555	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	4'530	6'000	0	10'530 CHF	97.35%	10'250'955.00	0.39	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	1'650	0	0	1'650 CHF	97.65%	1'611'225.00	0.06	a)
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	2'085	0	0	2'085 CHF	99.01%	2'064'358.50	0.08	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	3'160	0	0	3'160 CHF	98.77%	3'121'132.00	0.12	a)
CH0347082809	0.3000 % KBRFB 0.3 02/17/27	2'500	0	0	2'500 CHF	97.85%	2'446'250.00	0.09	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	2'350	0	0	2'350 CHF	97.40%	2'288'900.00	0.09	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	0	3'900	300	3'600 CHF	96.55%	3'475'800.00	0.13	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	2'450	200	0	2'650 CHF	98.74%	2'616'610.00	0.10	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	10'280	0	10'280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	6'370	200	0	6'570 CHF	97.72%	6'420'204.00	0.24	a)
CH0350030422	0.7000 % KWOPER 0.7 01/30/26	1'700	0	0	1'700 CHF	98.93%	1'681'810.00	0.06	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBSW 0.2 02/02/26	2'450	0	0	2'450 CHF	98.42%	2'411'290.00	0.09	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	8'200	500	0	8'700 CHF	98.05%	8'530'350.00	0.32	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	2'670	1'300	0	3'970 CHF	99.05%	3'932'285.00	0.15	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	2'500	0	0	2'500 CHF	97.30%	2'432'500.00	0.09	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	3'950	490	0	4'440 CHF	97.80%	4'342'320.00	0.16	a)
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	3'300	0	0	3'300 CHF	98.20%	3'240'600.00	0.12	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	2'000	0	0	2'000 CHF	98.90%	1'978'000.00	0.07	a)
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	1'540	0	1'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	850	0	0	850 CHF	98.35%	835'975.00	0.03	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	3'170	0	1'100	2'070 CHF	98.92%	2'047'644.00	0.08	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	2'690	0	0	2'690 CHF	98.85%	2'659'065.00	0.10	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.85%	988'500.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	9'130	0	700	8'430 CHF	98.48%	8'301'864.00	0.31	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNBK 0.15 09/26/25	900	0	0	900 CHF	98.64%	887'760.00	0.03	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	4'000	400	0	4'400 CHF	97.80%	4'303'200.00	0.16	a)
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	0	750	0	750 CHF	97.10%	728'250.00	0.03	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	2'950	0	2'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	12'370	0	2'000	10'370 CHF	98.12%	10'175'044.00	0.39	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	2'730	0	0	2'730 CHF	98.10%	2'678'130.00	0.10	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	2'790	900	0	3'690 CHF	99.05%	3'654'945.00	0.14	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	9'380	500	0	9'880 CHF	97.94%	9'676'472.00	0.37	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	0	2'000	0	2'000 CHF	97.55%	1'951'000.00	0.07	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	6'755	1'000	0	7'755 CHF	98.58%	7'644'879.00	0.29	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	7'260	0	0	7'260 CHF	98.93%	7'182'318.00	0.27	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	680	0	0	680 CHF	97.75%	664'700.00	0.03	a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	630	0	0	630 CHF	97.10%	611'730.00	0.02	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNFX 0 3/8 05/31/27	560	0	0	560 CHF	98.05%	549'080.00	0.02	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	4'650	0	0	4'650 CHF	99.40%	4'622'100.00	0.18	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	1'950	0	0	1'950 CHF	99.40%	1'938'300.00	0.07	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	96.35%	3'854'000.00	0.15	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	2'400	0	0	2'400 CHF	97.35%	2'336'400.00	0.09	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	0	500	0	500 CHF	96.60%	483'000.00	0.02	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	1'200	0	100	1'100 CHF	99.45%	1'093'950.00	0.04	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	0	1'000	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.04	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	98.89%	2'571'140.00	0.10	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	2'580	0	100	2'480 CHF	99.01%	2'455'448.00	0.09	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	7'070	0	500	6'570 CHF	98.29%	6'457'653.00	0.24	a)
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	0	1'800	0	1'800 CHF	96.45%	1'736'100.00	0.07	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	750	0	0	750 CHF	98.88%	741'600.00	0.03	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	8'725	300	120	8'905 CHF	97.48%	8'680'594.00	0.33	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	1'050	0	0	1'050 CHF	99.00%	1'039'500.00	0.04	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	10'420	0	0	10'420 CHF	97.45%	10'154'290.00	0.38	a)
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	850	750	0	1'600 CHF	98.95%	1'583'200.00	0.06	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'930	500	0	4'430 CHF	97.35%	4'312'605.00	0.16	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	10'090	1'000	100	10'990 CHF	98.05%	10'775'695.00	0.41	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	2'040	0	0	2'040 CHF	98.65%	2'012'460.00	0.08	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	4'420	0	4'420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	9'150	1'250	0	10'400 CHF	97.85%	10'176'400.00	0.39	a)
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	220	1'000	0	1'220 CHF	97.65%	1'191'330.00	0.05	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	2'775	0	2'775	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	1'080	0	1'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	1'090	300	100	1'290 CHF	97.55%	1'258'395.00	0.05	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	3'690	0	1'000	2'690 CHF	99.03%	2'663'907.00	0.10	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	8'880	0	0	8'880 CHF	97.59%	8'665'992.00	0.33	a)
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	850	0	100	750 CHF	97.60%	732'000.00	0.03	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	1'790	200	100	1'890 CHF	97.40%	1'840'860.00	0.07	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.79%	987'900.00	0.04	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	2'700	0	0	2'700 CHF	98.05%	2'647'350.00	0.10	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.10%	196'200.00	0.01	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	950	0	0	950 CHF	99.01%	940'595.00	0.04	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	6'000	1'000	170	6'830 CHF	97.55%	6'662'665.00	0.25	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	7'060	1'500	0	8'560 CHF	98.37%	8'420'472.00	0.32	a)
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	2'410	0	0	2'410 CHF	99.07%	2'387'587.00	0.09	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'490	500	100	4'890 CHF	98.45%	4'814'205.00	0.18	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	97.60%	2'732'800.00	0.10	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	4'670	500	0	5'170 CHF	97.95%	5'064'015.00	0.19	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'600	0	100	2'500 CHF	98.83%	2'470'750.00	0.09	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	800	0	0	800 CHF	98.54%	788'320.00	0.03	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	1'390	0	0	1'390 CHF	97.30%	1'352'470.00	0.05	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	300	2'300	0	2'600 CHF	98.50%	2'561'000.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	1'900	0	0	1'900 CHF	98.77%	1'876'630.00	0.07	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	1'855	0	0	1'855 CHF	100.23%	1'859'266.50	0.07	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	2'670	0	0	2'670 CHF	97.35%	2'599'245.00	0.10	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	7'270	550	0	7'820 CHF	98.64%	7'713'648.00	0.29	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	370	2'300	0	2'670 CHF	97.15%	2'593'905.00	0.10	a)
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	2'135	0	0	2'135 CHF	98.92%	2'111'942.00	0.08	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	860	1'000	0	1'860 CHF	97.85%	1'820'010.00	0.07	a)
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	4'835	0	4'835	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633336	0.3500 % WKBNWS 0.35 09/07/27	1'700	0	0	1'700 CHF	97.35%	1'654'950.00	0.06	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	2'500	0	0	2'500 CHF	98.25%	2'456'250.00	0.09	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	350	0	0	350 CHF	98.05%	343'175.00	0.01	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	905	500	0	1'405 CHF	96.55%	1'356'527.50	0.05	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	2'230	500	250	2'480 CHF	98.49%	2'442'552.00	0.09	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	2'180	0	0	2'180 CHF	99.44%	2'167'792.00	0.08	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	360	0	0	360 CHF	100.00%	360'000.00	0.01	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	0	2'900	0	2'900 CHF	99.65%	2'889'850.00	0.11	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	0	11'550	0	11'550 CHF	98.34%	11'358'270.00	0.43	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	1'000	0	0	1'000 CHF	98.45%	984'500.00	0.04	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	3'100	0	0	3'100 CHF	97.70%	3'028'700.00	0.11	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	2'050	0	0	2'050 CHF	98.75%	2'024'375.00	0.08	a)
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'180	0	0	1'180 CHF	97.90%	1'155'220.00	0.04	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'000	500	0	2'500 CHF	97.55%	2'438'750.00	0.09	a)
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	2'270	0	0	2'270 CHF	98.50%	2'235'950.00	0.08	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	5'600	0	0	5'600 CHF	98.10%	5'493'600.00	0.21	a)
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	98.35%	1'229'375.00	0.05	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.82%	1'976'400.00	0.07	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	700	600	0	1'300 CHF	97.85%	1'272'050.00	0.05	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.40%	1'968'000.00	0.07	a)
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	1'015	0	0	1'015 CHF	99.15%	1'006'372.50	0.04	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	3'000	0	0	3'000 CHF	98.75%	2'962'500.00	0.11	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKKB 0.2 03/28/25	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	2'670	0	2'670	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	0	1'400	0	1'400 CHF	97.70%	1'367'800.00	0.05	a)
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'250	0	200	2'050 CHF	99.67%	2'043'235.00	0.08	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	0	2'400	0	2'400 CHF	97.85%	2'348'400.00	0.09	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	2'790	0	2'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	1'500	200	100	1'600 CHF	97.20%	1'555'200.00	0.06	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	99.75%	3'142'125.00	0.12	a)
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	4'805	0	100	4'705 CHF	97.70%	4'596'785.00	0.17	a)
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	1'375	0	1'375	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	1'000	0	0	1'000 CHF	97.55%	975'500.00	0.04	a)
CH0419040735	0.3000 % WKBNWS 0.3 02/01/27	1'400	0	0	1'400 CHF	97.70%	1'367'800.00	0.05	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'900	200	1'900	200 CHF	100.30%	200'600.00	0.01	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	5'380	0	0	5'380 CHF	97.45%	5'242'810.00	0.20	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	2'560	0	0	2'560 CHF	98.85%	2'530'560.00	0.10	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	0	1'000	0	1'000 CHF	96.90%	969'000.00	0.04	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	0	10'300	0	10'300 CHF	96.70%	9'960'100.00	0.38	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMNVS 0 1/2 03/15/29	2'880	300	0	3'180 CHF	97.70%	3'106'860.00	0.12	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	4'050	0	100	3'950 CHF	99.85%	3'944'075.00	0.15	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	3'950	0	0	3'950 CHF	97.45%	3'849'275.00	0.15	a)
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	0	1'320	0	1'320 CHF	97.95%	1'292'940.00	0.05	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'300	0	0	1'300 CHF	98.60%	1'281'800.00	0.05	a)
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	1'500	0	0	1'500 CHF	98.00%	1'470'000.00	0.06	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	2'000	0	0	2'000 CHF	97.45%	1'949'000.00	0.07	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	3'920	0	3'920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	1'600	0	0	1'600 CHF	97.70%	1'563'200.00	0.06	a)
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	2'540	1'000	0	3'540 CHF	97.45%	3'449'730.00	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	0	2'500	0	2'500 CHF	95.55%	2'388'750.00	0.09	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	6'250	0	0	6'250 CHF	97.90%	6'118'750.00	0.23	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	900	0	0	900 CHF	96.60%	869'400.00	0.03	a)
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	990	0	0	990 CHF	94.80%	938'520.00	0.04	a)
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	96.50%	2'123'000.00	0.08	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'850	0	120	1'730 CHF	97.90%	1'693'670.00	0.06	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	1'850	0	0	1'850 CHF	98.40%	1'820'400.00	0.07	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	1'300	0	0	1'300 CHF	99.10%	1'288'300.00	0.05	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	2'000	0	2'000 CHF	99.00%	1'980'000.00	0.07	a)
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	8'025	0	0	8'025 CHF	98.99%	7'943'947.50	0.30	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	0	5'200	430	4'770 CHF	97.76%	4'663'152.00	0.18	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'200	0	0	1'200 CHF	98.50%	1'182'000.00	0.04	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	3'700	1'100	0	4'800 CHF	98.10%	4'708'800.00	0.18	a)
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	0	1'500	0	1'500 CHF	100.05%	1'500'750.00	0.06	a)
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	2'190	0	0	2'190 CHF	98.55%	2'158'245.00	0.08	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	9'800	500	100	10'200 CHF	97.54%	9'949'080.00	0.38	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	99.25%	1'588'000.00	0.06	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	4'370	0	4'370	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	3'150	0	0	3'150 CHF	99.10%	3'121'650.00	0.12	a)
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'160	0	0	1'160 CHF	98.90%	1'147'240.00	0.04	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	5'450	0	0	5'450 CHF	98.41%	5'363'345.00	0.20	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	2'060	0	100	1'960 CHF	99.43%	1'948'828.00	0.07	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNXX 0 3/4 10/12/28	1'170	900	0	2'070 CHF	98.85%	2'046'195.00	0.08	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	950	0	0	950 CHF	99.45%	944'775.00	0.04	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	1'400	0	400	1'000 CHF	98.85%	988'500.00	0.04	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	8'090	0	1'000	7'090 CHF	98.23%	6'964'507.00	0.26	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	8'145	0	0	8'145 CHF	98.80%	8'047'260.00	0.30	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	600	0	0	600 CHF	98.45%	590'700.00	0.02	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	750	0	0	750 CHF	98.05%	735'375.00	0.03	a)
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	2'210	0	300	1'910 CHF	99.66%	1'903'506.00	0.07	a)
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	2'500	0	0	2'500 CHF	98.55%	2'463'750.00	0.09	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	0	1'000	0	1'000 CHF	98.00%	980'000.00	0.04	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	5'070	1'200	120	6'150 CHF	98.24%	6'041'760.00	0.23	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	0	1'000	170	830 CHF	97.25%	807'175.00	0.03	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.40%	194'800.00	0.01	a)
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	900	0	0	900 CHF	97.40%	876'600.00	0.03	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	5'400	0	1'200	4'200 CHF	97.95%	4'113'900.00	0.16	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	1'750	0	0	1'750 CHF	98.97%	1'731'975.00	0.07	a)
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	1'200	0	0	1'200 CHF	98.40%	1'180'800.00	0.04	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	0	500	250	250 CHF	96.90%	242'250.00	0.01	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	2'080	0	2'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	0	2'850	0	2'850 CHF	96.55%	2'751'675.00	0.10	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	0	1'380	0	1'380 CHF	96.35%	1'329'630.00	0.05	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	4'750	0	0	4'750 CHF	97.90%	4'650'250.00	0.18	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	2'990	0	2'990	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.80%	1'936'000.00	0.07	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	1'400	0	0	1'400 CHF	96.50%	1'351'000.00	0.05	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	0	1'500	0	1'500 CHF	95.00%	1'425'000.00	0.05	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	4'510	0	100	4'410 CHF	95.50%	4'211'550.00	0.16	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	1'240	400	0	1'640 CHF	95.65%	1'568'660.00	0.06	a)
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	2'760	0	110	2'650 CHF	98.80%	2'618'200.00	0.10	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	640	600	0	1'240 CHF	96.85%	1'200'940.00	0.05	a)
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	99.43%	1'193'160.00	0.05	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	3'060	0	0	3'060 CHF	99.30%	3'038'580.00	0.12	a)
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	2'100	150	0	2'250 CHF	98.30%	2'211'750.00	0.08	a)
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	1'890	0	1'890	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	2'755	0	200	2'555 CHF	98.86%	2'525'873.00	0.10	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	1'560	0	0	1'560 CHF	99.00%	1'544'400.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	0	500	0	500 CHF	96.00%	480'000.00	0.02	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	1'200	400	100	1'500 CHF	99.10%	1'486'500.00	0.06	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	900	6'000	100	6'800 CHF	97.20%	6'609'600.00	0.25	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	1'340	0	1'340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	0	3'200	0	3'200 CHF	95.90%	3'068'800.00	0.12	a)
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'810	0	300	1'510 CHF	98.57%	1'488'407.00	0.06	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	3'930	0	3'930	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	1'200	0	0	1'200 CHF	98.90%	1'186'800.00	0.04	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'130	0	0	1'130 CHF	98.57%	1'113'841.00	0.04	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	1'530	0	1'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'630	0	1'630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	1'750	0	0	1'750 CHF	98.05%	1'715'875.00	0.06	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	96.70%	1'740'600.00	0.07	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'230	200	0	2'430 CHF	96.90%	2'354'670.00	0.09	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'180	0	0	2'180 CHF	97.25%	2'120'050.00	0.08	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	0	1'000	0	1'000 CHF	95.45%	954'500.00	0.04	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	2'300	0	600	1'700 CHF	99.30%	1'688'100.00	0.06	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	4'420	0	300	4'120 CHF	98.81%	4'070'972.00	0.15	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	95.80%	1'724'400.00	0.07	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	6'590	0	900	5'690 CHF	97.11%	5'525'559.00	0.21	a)
CH0485261520	0.1250 % JURCTY 0 1/8 04/20/28	0	2'750	0	2'750 CHF	97.35%	2'677'125.00	0.10	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	95.45%	1'813'550.00	0.07	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	2'750	0	300	2'450 CHF	98.70%	2'418'150.00	0.09	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	1'150	0	0	1'150 CHF	97.55%	1'121'825.00	0.04	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'555	0	0	2'555 CHF	98.85%	2'525'617.50	0.10	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	670	0	0	670 CHF	98.27%	658'409.00	0.02	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	93.25%	932'500.00	0.04	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	1'100	0	0	1'100 CHF	97.75%	1'075'250.00	0.04	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	3'565	400	0	3'965 CHF	97.55%	3'867'857.50	0.15	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	97.30%	1'556'800.00	0.06	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	5'550	300	100	5'750 CHF	98.31%	5'652'825.00	0.21	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	1'650	0	0	1'650 CHF	97.65%	1'611'225.00	0.06	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	830	0	0	830 CHF	98.47%	817'301.00	0.03	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	4'510	0	120	4'390 CHF	96.90%	4'253'910.00	0.16	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'150	0	100	1'050 CHF	98.40%	1'033'200.00	0.04	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	1'890	450	0	2'340 CHF	96.90%	2'267'460.00	0.09	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	3'500	0	0	3'500 CHF	95.65%	3'347'750.00	0.13	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	1'700	200	0	1'900 CHF	98.30%	1'867'700.00	0.07	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	95.15%	1'903'000.00	0.07	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	2'330	0	0	2'330 CHF	96.10%	2'239'130.00	0.08	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	1'710	0	400	1'310 CHF	96.85%	1'268'735.00	0.05	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	0	1'000	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.04	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	97.70%	1'172'400.00	0.04	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	4'300	0	0	4'300 CHF	98.15%	4'220'450.00	0.16	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	3'840	0	0	3'840 CHF	97.31%	3'736'704.00	0.14	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	0	1'000	0	1'000 CHF	94.60%	946'000.00	0.04	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	4'140	0	0	4'140 CHF	94.80%	3'924'720.00	0.15	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	1'200	150	0	1'350 CHF	95.55%	1'289'925.00	0.05	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	95.60%	1'816'400.00	0.07	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	3'450	0	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	0	3'100	0	3'100 CHF	95.40%	2'957'400.00	0.11	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	98.46%	2'166'120.00	0.08	a)
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	2'200	400	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	2'450	0	0	2'450 CHF	98.20%	2'405'900.00	0.09	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	3'910	0	0	3'910 CHF	98.86%	3'865'426.00	0.15	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBNSW 0 02/14/29	0	1'000	0	1'000 CHF	94.75%	947'500.00	0.04	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	96.65%	2'512'900.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	400	0	0	400 CHF	94.60%	378'400.00	0.01	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	0	2'000	0	2'000 CHF	95.50%	1'910'000.00	0.07	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	2'210	0	0	2'210 CHF	97.85%	2'162'485.00	0.08	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	2'200	0	0	2'200 CHF	97.75%	2'150'500.00	0.08	a)
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	2'200	0	0	2'200 CHF	97.50%	2'145'000.00	0.08	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	7'555	0	0	7'555 CHF	96.45%	7'286'797.50	0.28	a)
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	1'800	0	0	1'800 CHF	97.85%	1'761'300.00	0.07	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	940	500	0	1'440 CHF	97.70%	1'406'880.00	0.05	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	4'235	0	0	4'235 CHF	99.30%	4'205'355.00	0.16	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	4'230	0	0	4'230 CHF	96.85%	4'096'755.00	0.16	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	2'100	0	0	2'100 CHF	99.00%	2'079'000.00	0.08	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	6'180	0	0	6'180 CHF	96.11%	5'939'598.00	0.22	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	1'900	500	0	2'400 CHF	97.00%	2'328'000.00	0.09	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	5'570	0	0	5'570 CHF	97.33%	5'421'281.00	0.21	a)
CH0538763514	0.8750 % KOROil 0 7/8 04/21/25	2'095	0	2'095	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'840	0	0	1'840 CHF	97.75%	1'798'600.00	0.07	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	6'840	1'250	100	7'990 CHF	96.65%	7'722'335.00	0.29	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	99.58%	2'290'340.00	0.09	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	3'160	0	3'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	2'750	0	0	2'750 CHF	99.95%	2'748'625.00	0.10	a)
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	99.70%	1'096'700.00	0.04	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'430	700	100	2'030 CHF	98.25%	1'994'475.00	0.08	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	880	1'700	0	2'580 CHF	96.00%	2'476'800.00	0.09	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	1'900	0	0	1'900 CHF	98.96%	1'880'240.00	0.07	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	2'200	0	100	2'100 CHF	99.17%	2'082'570.00	0.08	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	4'200	0	0	4'200 CHF	98.35%	4'130'700.00	0.16	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	2'020	0	2'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	4'300	0	200	4'100 CHF	96.45%	3'954'450.00	0.15	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.20%	1'964'000.00	0.07	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'800	0	0	1'800 CHF	99.12%	1'784'160.00	0.07	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'340	0	0	3'340 CHF	99.67%	3'328'978.00	0.13	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	2'750	0	900	1'850 CHF	97.75%	1'808'375.00	0.07	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	6'185	0	1'500	4'685 CHF	99.35%	4'654'547.50	0.18	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	0	250	0	250 CHF	97.60%	244'000.00	0.01	a)
CH0554992070	0.2625 % KOROil 0.2625 07/30/27 EMTN	2'230	0	0	2'230 CHF	97.00%	2'163'100.00	0.08	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779037	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 5JL	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	2'780	900	100	3'580 CHF	95.80%	3'429'640.00	0.13	a)
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	1'470	0	100	1'370 CHF	98.95%	1'355'615.00	0.05	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	1'880	0	0	1'880 CHF	95.75%	1'800'100.00	0.07	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	1'700	0	0	1'700 CHF	98.20%	1'669'400.00	0.06	a)
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	0	3'500	120	3'380 CHF	95.85%	3'239'730.00	0.12	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	2'300	200	0	2'500 CHF	99.10%	2'477'500.00	0.09	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	2'590	650	100	3'140 CHF	95.60%	3'001'840.00	0.11	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	2'060	0	700	1'360 CHF	98.71%	1'342'456.00	0.05	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	0	2'900	0	2'900 CHF	98.10%	2'844'900.00	0.11	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	3'400	0	0	3'400 CHF	96.65%	3'286'100.00	0.12	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	2'860	0	0	2'860 CHF	98.91%	2'828'826.00	0.11	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	2'900	0	200	2'700 CHF	99.43%	2'684'610.00	0.10	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	0	2'000	0	2'000 CHF	96.20%	1'924'000.00	0.07	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	2'300	200	0	2'500 CHF	95.90%	2'397'500.00	0.09	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	750	0	0	750 CHF	97.50%	731'250.00	0.03	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	3'050	200	950	2'300 CHF	97.30%	2'237'900.00	0.08	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	810	1'240	0	2'050 CHF	96.60%	1'980'300.00	0.08	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	0	4'500	600	3'900 CHF	95.49%	3'724'110.00	0.14	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	1'800	0	0	1'800 CHF	97.20%	1'749'600.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.75%	957'500.00	0.04	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	97.10%	1'213'750.00	0.05	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	95.35%	1'525'600.00	0.06	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	2'250	200	0	2'450 CHF	94.40%	2'312'800.00	0.09	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	3'910	200	0	4'110 CHF	96.70%	3'974'370.00	0.15	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'655	0	0	1'655 CHF	97.10%	1'607'005.00	0.06	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	96.80%	1'548'800.00	0.06	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	2'600	1'600	0	4'200 CHF	95.05%	3'992'100.00	0.15	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	1'580	0	0	1'580 CHF	98.35%	1'553'930.00	0.06	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	9'930	1'050	0	10'980 CHF	96.43%	10'588'014.00	0.40	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	3'130	0	0	3'130 CHF	95.70%	2'995'410.00	0.11	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	750	1'400	0	2'150 CHF	97.10%	2'087'650.00	0.08	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	1'670	0	0	1'670 CHF	97.55%	1'629'085.00	0.06	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	99.05%	1'287'650.00	0.05	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	3'900	1'000	0	4'900 CHF	96.45%	4'726'050.00	0.18	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	1'200	0	0	1'200 CHF	96.35%	1'156'200.00	0.04	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	1'100	0	0	1'100 CHF	97.95%	1'077'450.00	0.04	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	900	650	0	1'550 CHF	95.75%	1'484'125.00	0.06	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'325	0	0	1'325 CHF	97.70%	1'294'525.00	0.05	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	5'680	0	100	5'580 CHF	97.10%	5'418'180.00	0.21	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	4'920	500	0	5'420 CHF	96.70%	5'241'140.00	0.20	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	1'565	650	0	2'215 CHF	96.25%	2'131'937.50	0.08	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	3'400	200	0	3'600 CHF	97.40%	3'506'400.00	0.13	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	3'410	0	0	3'410 CHF	96.40%	3'287'240.00	0.12	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	2'190	0	0	2'190 CHF	97.70%	2'139'630.00	0.08	a)
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	0	2'700	0	2'700 CHF	95.65%	2'582'550.00	0.10	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZSSW 0.2 06/15/26	1'500	0	0	1'500 CHF	97.70%	1'465'500.00	0.06	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	96.95%	3'490'200.00	0.13	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	94.90%	1'328'600.00	0.05	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNBK 1 07/28/31	2'000	0	500	1'500 CHF	95.35%	1'430'250.00	0.05	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	94.75%	947'500.00	0.04	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'500	200	0	1'700 CHF	95.75%	1'627'750.00	0.06	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	3'440	200	0	3'640 CHF	96.55%	3'514'420.00	0.13	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	3'900	0	100	3'800 CHF	96.15%	3'653'700.00	0.14	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	2'400	0	1'000	1'400 CHF	97.10%	1'359'400.00	0.05	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	3'300	500	0	3'800 CHF	97.05%	3'687'900.00	0.14	a)
CH1122290187	0.0000 % PSYPO 0 11/17/27 704	2'100	500	120	2'480 CHF	96.71%	2'398'408.00	0.09	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	96.65%	2'899'500.00	0.11	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	400	0	0	400 CHF	96.80%	387'200.00	0.01	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	2'280	850	0	3'130 CHF	94.70%	2'964'110.00	0.11	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	2'050	0	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'110	0	0	1'110 CHF	98.14%	1'089'354.00	0.04	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	1'985	0	0	1'985 CHF	97.85%	1'942'322.50	0.07	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	1'750	0	0	1'750 CHF	96.40%	1'687'000.00	0.06	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	1'400	600	0	2'000 CHF	94.65%	1'893'000.00	0.07	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	96.65%	2'706'200.00	0.10	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'525	0	0	1'525 CHF	98.46%	1'501'515.00	0.06	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	900	500	0	1'400 CHF	96.00%	1'344'000.00	0.05	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	3'980	1'000	0	4'980 CHF	96.00%	4'780'800.00	0.18	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	1'990	0	0	1'990 CHF	96.75%	1'925'325.00	0.07	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	0	3'400	0	3'400 CHF	95.20%	3'236'800.00	0.12	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	1'850	500	0	2'350 CHF	95.55%	2'245'425.00	0.09	a)
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	2'380	0	500	1'880 CHF	97.70%	1'836'760.00	0.07	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	2'140	0	0	2'140 CHF	97.05%	2'076'870.00	0.08	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	3'840	300	0	4'140 CHF	97.50%	4'036'500.00	0.15	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	2'200	0	0	2'200 CHF	96.00%	2'112'000.00	0.08	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	3'215	1'200	4'415	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	4'640	0	0	4'640 CHF	97.35%	4'517'040.00	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	3'350	0	1'000	2'350 CHF	96.80%	2'274'800.00	0.09	a)
CH1142512339	0.5994 % BICI 0.5994 04/26/27 EMTN	3'725	0	1'700	2'025 CHF	97.20%	1'968'300.00	0.07	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	96.25%	2'695'000.00	0.10	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	4'500	0	2'500	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.07	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	0	1'600	0	1'600 CHF	95.65%	1'530'400.00	0.06	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	2'280	0	0	2'280 CHF	95.90%	2'186'520.00	0.08	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	2'900	2'000	0	4'900 CHF	95.90%	4'699'100.00	0.18	a)
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	2'200	0	100	2'100 CHF	97.45%	2'046'450.00	0.08	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	4'000	1'400	1'800	3'600 CHF	96.75%	3'483'000.00	0.13	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	5'000	0	0	5'000 CHF	96.30%	4'815'000.00	0.18	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	3'000	0	500	2'500 CHF	97.30%	2'432'500.00	0.09	a)
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	2'150	450	0	2'600 CHF	95.65%	2'486'900.00	0.09	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	4'750	0	0	4'750 CHF	96.28%	4'573'300.00	0.17	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'900	500	0	2'400 CHF	95.75%	2'298'000.00	0.09	a)
CH1148266237	0.3500 % BSTDBK 0.35 03/15/27 EMTN	200	0	0	200 CHF	93.20%	186'400.00	0.01	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	0	2'650	0	2'650 CHF	96.25%	2'550'625.00	0.10	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'200	200	0	2'400 CHF	94.15%	2'259'600.00	0.09	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	1'690	0	0	1'690 CHF	97.10%	1'640'990.00	0.06	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	0	1'300	0	1'300 CHF	96.60%	1'255'800.00	0.05	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	3'100	0	1'000	2'100 CHF	98.05%	2'059'050.00	0.08	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	5'030	0	0	5'030 CHF	97.99%	4'928'897.00	0.19	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	0	2'000	0	2'000 CHF	96.10%	1'922'000.00	0.07	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	4'010	300	750	3'560 CHF	97.70%	3'478'120.00	0.13	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	5'525	200	1'100	4'625 CHF	97.25%	4'497'812.50	0.17	a)
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	3'700	0	0	3'700 CHF	98.30%	3'637'100.00	0.14	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	95.30%	2'859'000.00	0.11	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	1'980	0	0	1'980 CHF	97.55%	1'931'490.00	0.07	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	1'000	200	200	1'000 CHF	96.15%	961'500.00	0.04	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	2'070	0	2'070	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	3'920	0	0	3'920 CHF	98.15%	3'847'480.00	0.15	a)
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	900	0	0	900 CHF	96.20%	865'800.00	0.03	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	1'920	0	1'920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	2'320	0	0	2'320 CHF	98.14%	2'276'848.00	0.09	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	98.50%	1'773'000.00	0.07	a)
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	0	1'000	0	1'000 CHF	97.20%	972'000.00	0.04	a)
CH1164800661	0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29	0	1'300	0	1'300 CHF	96.40%	1'253'200.00	0.05	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	9'750	0	0	9'750 CHF	98.65%	9'618'375.00	0.36	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	1'580	0	0	1'580 CHF	98.00%	1'548'400.00	0.06	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'810	0	0	1'810 CHF	98.05%	1'774'705.00	0.07	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	98.45%	2'362'800.00	0.09	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	3'740	0	140	3'600 CHF	97.90%	3'524'400.00	0.13	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	4'570	0	0	4'570 CHF	99.15%	4'531'155.00	0.17	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	0	4'200	0	4'200 CHF	100.50%	4'221'000.00	0.16	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	0	2'500	0	2'500 CHF	100.90%	2'522'500.00	0.10	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	4'290	0	0	4'290 CHF	100.27%	4'301'583.00	0.16	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	2'390	0	0	2'390 CHF	100.30%	2'397'170.00	0.09	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'780	0	750	1'030 CHF	98.10%	1'010'430.00	0.04	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	3'180	250	600	2'830 CHF	98.50%	2'787'550.00	0.11	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	98.20%	2'651'400.00	0.10	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	500	570	0	1'070 CHF	98.70%	1'056'090.00	0.04	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	2'600	300	0	2'900 CHF	100.60%	2'917'400.00	0.11	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	1'900	0	100	1'800 CHF	99.80%	1'796'400.00	0.07	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	3'150	0	0	3'150 CHF	99.50%	3'134'250.00	0.12	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	0	500	0	500 CHF	99.10%	495'500.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	3'750	0	1'500	2'250 CHF	99.60%	2'241'000.00	0.08	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	0	2'150	0	2'150 CHF	99.60%	2'141'400.00	0.08	a)
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.50%	995'000.00	0.04	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	100.50%	2'713'500.00	0.10	a)
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	2'200	200	0	2'400 CHF	100.90%	2'421'600.00	0.09	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	0	1'750	0	1'750 CHF	102.10%	1'786'750.00	0.07	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'230	0	0	2'230 CHF	99.60%	2'221'080.00	0.08	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.40%	2'982'000.00	0.11	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	4'800	0	0	4'800 CHF	100.20%	4'809'600.00	0.18	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	2'600	0	0	2'600 CHF	101.30%	2'633'800.00	0.10	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.85%	2'995'500.00	0.11	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	1'190	0	0	1'190 CHF	99.00%	1'178'100.00	0.04	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	100.85%	2'622'100.00	0.10	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	3'290	0	0	3'290 CHF	100.75%	3'314'675.00	0.13	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	100.55%	2'413'200.00	0.09	a)
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	2'235	0	1'000	1'235 CHF	101.60%	1'254'760.00	0.05	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	2'000	0	0	2'000 CHF	100.45%	2'009'000.00	0.08	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	2'600	0	0	2'600 CHF	99.72%	2'592'720.00	0.10	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	2'950	0	2'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	2'400	0	0	2'400 CHF	100.35%	2'408'400.00	0.09	a)
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	2'200	0	0	2'200 CHF	99.95%	2'198'900.00	0.08	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	3'480	0	0	3'480 CHF	102.45%	3'565'260.00	0.14	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	1'325	0	0	1'325 CHF	99.96%	1'324'470.00	0.05	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.90%	2'997'000.00	0.11	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	2'700	0	0	2'700 CHF	101.55%	2'741'850.00	0.10	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	2'500	0	500	2'000 CHF	100.35%	2'007'000.00	0.08	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	1'120	0	0	1'120 CHF	100.10%	1'121'120.00	0.04	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.00%	1'530'000.00	0.06	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	1'200	400	0	1'600 CHF	102.60%	1'641'600.00	0.06	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	2'660	0	0	2'660 CHF	101.80%	2'707'880.00	0.10	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	2'000	0	0	2'000 CHF	101.55%	2'031'000.00	0.08	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	3'000	200	800	2'400 CHF	101.35%	2'432'400.00	0.09	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	2'280	0	0	2'280 CHF	100.70%	2'295'960.00	0.09	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	0	1'600	0	1'600 CHF	103.65%	1'658'400.00	0.06	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	2'300	0	100	2'200 CHF	101.15%	2'225'300.00	0.08	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	7'100	0	0	7'100 CHF	100.90%	7'163'900.00	0.27	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	3'240	0	650	2'590 CHF	100.45%	2'601'655.00	0.10	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.85%	3'055'500.00	0.12	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	1'520	0	0	1'520 CHF	101.25%	1'539'000.00	0.06	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	2'300	0	500	1'800 CHF	102.55%	1'845'900.00	0.07	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'900	0	0	1'900 CHF	99.71%	1'894'490.00	0.07	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	2'900	0	500	2'400 CHF	102.25%	2'454'000.00	0.09	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	2'560	0	0	2'560 CHF	99.67%	2'551'552.00	0.10	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	2'150	0	0	2'150 CHF	99.65%	2'142'475.00	0.08	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	3'610	750	0	4'360 CHF	102.05%	4'449'380.00	0.17	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'350	0	0	2'350 CHF	99.68%	2'342'480.00	0.09	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'900	0	0	1'900 CHF	99.70%	1'894'300.00	0.07	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	3'350	0	0	3'350 CHF	101.45%	3'398'575.00	0.13	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	0	2'300	0	2'300 CHF	105.00%	2'415'000.00	0.09	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	99.95%	3'098'450.00	0.12	a)
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	2'810	0	0	2'810 CHF	100.75%	2'831'075.00	0.11	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	0	2'700	0	2'700 CHF	103.05%	2'782'350.00	0.11	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	0	2'700	0	2'700 CHF	102.24%	2'760'480.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	1'340	0	0	1'340 CHF	102.00%	1'366'800.00	0.05	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	2'300	0	0	2'300 CHF	102.05%	2'347'150.00	0.09	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	3'750	0	0	3'750 CHF	106.30%	3'986'250.00	0.15	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'340	0	0	2'340 CHF	104.25%	2'439'450.00	0.09	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	1'200	0	0	1'200 CHF	101.10%	1'213'200.00	0.05	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	4'545	0	0	4'545 CHF	100.93%	4'587'268.50	0.17	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	3'545	0	400	3'145 CHF	101.90%	3'204'755.00	0.12	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	2'800	0	0	2'800 CHF	102.30%	2'864'400.00	0.11	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	0	2'900	0	2'900 CHF	104.70%	3'036'300.00	0.12	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	2'250	250	0	2'500 CHF	102.25%	2'556'250.00	0.10	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	2'500	0	0	2'500 CHF	103.20%	2'580'000.00	0.10	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	1'680	0	0	1'680 CHF	101.30%	1'701'840.00	0.06	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'700	0	650	1'050 CHF	101.30%	1'063'650.00	0.04	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	4'600	800	0	5'400 CHF	100.95%	5'451'300.00	0.21	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	2'400	0	0	2'400 CHF	103.80%	2'491'200.00	0.09	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	1'900	0	0	1'900 CHF	100.95%	1'918'050.00	0.07	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	104.75%	2'095'000.00	0.08	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.80%	1'439'200.00	0.05	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	1'250	0	0	1'250 CHF	101.02%	1'262'750.00	0.05	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	3'690	0	0	3'690 CHF	103.20%	3'808'080.00	0.14	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	104.80%	2'515'200.00	0.10	a)
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	103.45%	1'344'850.00	0.05	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	1'245	0	0	1'245 CHF	101.80%	1'267'410.00	0.05	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'600	0	0	1'600 CHF	101.06%	1'616'960.00	0.06	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	2'200	0	100	2'100 CHF	103.95%	2'182'950.00	0.08	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.10%	1'021'000.00	0.04	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	400	0	0	400 CHF	102.90%	411'600.00	0.02	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'610	0	0	3'610 CHF	102.75%	3'709'275.00	0.14	a)
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	2'340	0	0	2'340 CHF	100.67%	2'355'678.00	0.09	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	1'910	0	0	1'910 CHF	103.50%	1'976'850.00	0.07	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	2'590	0	0	2'590 CHF	100.85%	2'612'015.00	0.10	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	3'960	400	0	4'360 CHF	104.95%	4'575'820.00	0.17	a)
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	100.87%	1'613'920.00	0.06	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	4'200	400	0	4'600 CHF	103.60%	4'765'600.00	0.18	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	2'130	0	0	2'130 CHF	101.43%	2'160'459.00	0.08	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	3'150	0	200	2'950 CHF	101.49%	2'993'955.00	0.11	a)
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	2'200	0	100	2'100 CHF	104.60%	2'196'600.00	0.08	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'290	0	0	2'290 CHF	100.45%	2'300'305.00	0.09	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	1'800	300	0	2'100 CHF	101.51%	2'131'710.00	0.08	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	900	1'800	200	2'500 CHF	105.95%	2'648'750.00	0.10	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	1'600	0	0	1'600 CHF	101.73%	1'627'680.00	0.06	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	2'440	400	100	2'740 CHF	101.15%	2'771'510.00	0.10	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	2'600	200	0	2'800 CHF	104.20%	2'917'600.00	0.11	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	2'780	0	0	2'780 CHF	100.70%	2'799'460.00	0.11	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	2'280	0	0	2'280 CHF	102.35%	2'333'580.00	0.09	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	1'380	0	0	1'380 CHF	103.05%	1'422'090.00	0.05	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	104.80%	2'724'800.00	0.10	a)
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	2'500	0	0	2'500 CHF	99.65%	2'491'250.00	0.09	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	1'630	0	0	1'630 CHF	101.26%	1'650'538.00	0.06	a)
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	1'940	0	0	1'940 CHF	102.40%	1'986'560.00	0.08	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBSW 2.05 07/24/28	3'000	0	0	3'000 CHF	103.60%	3'108'000.00	0.12	a)
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	1'800	0	0	1'800 CHF	101.20%	1'821'600.00	0.07	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	101.80%	1'425'200.00	0.05	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	3'080	0	0	3'080 CHF	100.90%	3'107'720.00	0.12	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	2'200	200	0	2'400 CHF	103.60%	2'486'400.00	0.09	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	2'260	0	100	2'160 CHF	101.08%	2'183'328.00	0.08	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'475	0	0	1'475 CHF	100.10%	1'476'475.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	3'200	0	0	3'200 CHF	105.90%	3'388'800.00	0.13	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	5'600	0	0	5'600 CHF	103.70%	5'807'200.00	0.22	a)
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	1'550	0	1'550 CHF	105.65%	1'637'575.00	0.06	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	2'250	0	0	2'250 CHF	103.30%	2'324'250.00	0.09	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	0	7'950	0	7'950 CHF	103.34%	8'215'530.00	0.31	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	1'215	320	0	1'535 CHF	105.05%	1'612'517.50	0.06	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	100.52%	2'311'960.00	0.09	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	3'300	0	0	3'300 CHF	103.65%	3'420'450.00	0.13	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	4'250	0	0	4'250 CHF	102.30%	4'347'750.00	0.16	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	2'970	0	0	2'970 CHF	102.45%	3'042'765.00	0.12	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	1'550	0	0	1'550 CHF	100.90%	1'563'950.00	0.06	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	2'200	400	0	2'600 CHF	101.95%	2'650'700.00	0.10	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	0	2'500	100	2'400 CHF	104.15%	2'499'600.00	0.09	a)
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	1'800	0	0	1'800 CHF	101.05%	1'818'900.00	0.07	a)
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	1'540	0	0	1'540 CHF	104.00%	1'601'600.00	0.06	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLILJ 2.35 03/01/27	1'125	0	0	1'125 CHF	102.35%	1'151'437.50	0.04	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	103.15%	3'197'650.00	0.12	a)
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	0	500	0	500 CHF	105.85%	529'250.00	0.02	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	1'780	200	0	1'980 CHF	100.85%	1'996'830.00	0.08	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	1'030	0	0	1'030 CHF	102.30%	1'053'690.00	0.04	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	3'000	400	0	3'400 CHF	105.65%	3'592'100.00	0.14	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	105.45%	2'109'000.00	0.08	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.55%	2'051'000.00	0.08	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	1'800	300	0	2'100 CHF	101.60%	2'133'600.00	0.08	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	105.60%	3'168'000.00	0.12	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	1'800	0	0	1'800 CHF	102.40%	1'843'200.00	0.07	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	101.30%	1'874'050.00	0.07	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	3'200	0	100	3'100 CHF	103.35%	3'203'850.00	0.12	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	1'470	500	0	1'970 CHF	101.40%	1'997'580.00	0.08	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	104.35%	1'565'250.00	0.06	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	104.40%	2'296'800.00	0.09	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	3'690	0	0	3'690 CHF	102.06%	3'766'014.00	0.14	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	1'370	0	1'370	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	4'200	200	0	4'400 CHF	103.75%	4'565'000.00	0.17	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	4'130	300	100	4'330 CHF	103.10%	4'464'230.00	0.17	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	2'400	650	0	3'050 CHF	105.25%	3'210'125.00	0.12	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	2'580	250	100	2'730 CHF	104.30%	2'847'390.00	0.11	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	2'760	0	0	2'760 CHF	101.75%	2'808'300.00	0.11	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	3'080	0	100	2'980 CHF	103.60%	3'087'280.00	0.12	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	2'770	0	0	2'770 CHF	102.90%	2'850'330.00	0.11	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	104.90%	3'776'400.00	0.14	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	1'500	0	0	1'500 CHF	101.15%	1'517'250.00	0.06	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	103.15%	2'269'300.00	0.09	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	2'690	0	0	2'690 CHF	103.15%	2'774'735.00	0.11	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	2'700	300	0	3'000 CHF	103.35%	3'100'500.00	0.12	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	4'620	100	0	4'720 CHF	103.55%	4'887'560.00	0.19	a)
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	105.50%	1'055'000.00	0.04	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	3'880	0	0	3'880 CHF	101.60%	3'942'080.00	0.15	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	102.40%	2'252'800.00	0.09	a)
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	106.70%	1'387'100.00	0.05	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	106.30%	2'551'200.00	0.10	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	4'830	200	0	5'030 CHF	102.70%	5'165'810.00	0.20	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	3'150	0	3'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	106.00%	1'908'000.00	0.07	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	3'200	400	0	3'600 CHF	104.30%	3'754'800.00	0.14	a)
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	2'300	0	0	2'300 CHF	103.00%	2'369'000.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	1'800	0	0	1'800 CHF	100.50%	1'809'000.00	0.07	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	1'700	0	0	1'700 CHF	102.35%	1'739'950.00	0.07	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	1'330	0	0	1'330 CHF	101.30%	1'347'290.00	0.05	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	1'300	0	0	1'300 CHF	101.50%	1'319'500.00	0.05	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	3'180	0	0	3'180 CHF	102.63%	3'263'634.00	0.12	a)
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	2'185	0	0	2'185 CHF	101.30%	2'213'405.00	0.08	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	700	0	0	700 CHF	101.25%	708'750.00	0.03	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	5'070	0	0	5'070 CHF	102.90%	5'217'030.00	0.20	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	2'150	0	0	2'150 CHF	101.70%	2'186'550.00	0.08	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	3'000	0	0	3'000 CHF	102.30%	3'069'000.00	0.12	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	2'580	0	0	2'580 CHF	101.95%	2'630'310.00	0.10	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	105.60%	3'379'200.00	0.13	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	2'400	0	0	2'400 CHF	103.05%	2'473'200.00	0.09	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	2'130	300	0	2'430 CHF	102.75%	2'496'825.00	0.09	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	1'200	0	0	1'200 CHF	103.30%	1'239'600.00	0.05	a)
CH1271007952	2.3750 % HYN0E 2 3/8 01/26/29 EMTN	1'300	300	0	1'600 CHF	103.00%	1'648'000.00	0.06	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	105.00%	2'520'000.00	0.10	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	1'500	500	0	2'000 CHF	102.60%	2'052'000.00	0.08	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	103.85%	2'700'100.00	0.10	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	103.20%	2'580'000.00	0.10	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	3'375	0	0	3'375 CHF	104.90%	3'540'375.00	0.13	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	875	0	100	775 CHF	101.06%	783'215.00	0.03	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	1'900	0	130	1'770 CHF	100.98%	1'787'346.00	0.07	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	1'400	600	0	2'000 CHF	103.20%	2'064'000.00	0.08	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	0	4'200	0	4'200 CHF	103.65%	4'353'300.00	0.16	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	900	0	0	900 CHF	101.30%	911'700.00	0.03	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	103.95%	2'390'850.00	0.09	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	2'400	0	0	2'400 CHF	104.70%	2'512'800.00	0.10	a)
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	875	0	0	875 CHF	101.34%	886'725.00	0.03	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN	2'970	0	2'970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	105.80%	2'539'200.00	0.10	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	1'500	0	0	1'500 CHF	101.33%	1'519'950.00	0.06	a)
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	1'600	300	0	1'900 CHF	105.70%	2'008'300.00	0.08	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	1'900	0	0	1'900 CHF	101.70%	1'932'300.00	0.07	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	1'095	0	0	1'095 CHF	102.95%	1'127'302.50	0.04	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	103.95%	1'871'100.00	0.07	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	2'080	0	100	1'980 CHF	102.20%	2'023'560.00	0.08	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	3'170	500	0	3'670 CHF	103.25%	3'789'275.00	0.14	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	2'100	0	100	2'000 CHF	102.00%	2'040'000.00	0.08	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	4'460	400	100	4'760 CHF	102.25%	4'867'100.00	0.18	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	103.20%	2'476'800.00	0.09	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	1'160	725	0	1'885 CHF	101.70%	1'917'045.00	0.07	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	3'360	240	0	3'600 CHF	103.30%	3'718'800.00	0.14	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	104.65%	2'825'550.00	0.11	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	1'690	0	100	1'590 CHF	103.10%	1'639'290.00	0.06	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	3'480	0	0	3'480 CHF	103.60%	3'605'280.00	0.14	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	2'200	0	2'200 CHF	104.20%	2'292'400.00	0.09	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	3'240	0	0	3'240 CHF	99.40%	3'220'560.00	0.12	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	2'600	0	0	2'600 CHF	102.30%	2'659'800.00	0.10	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	2'000	0	100	1'900 CHF	102.35%	1'944'650.00	0.07	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	3'200	200	0	3'400 CHF	102.45%	3'483'300.00	0.13	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	3'390	0	0	3'390 CHF	103.70%	3'515'430.00	0.13	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	3'240	0	0	3'240 CHF	101.80%	3'298'320.00	0.12	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	1'500	500	0	2'000 CHF	103.90%	2'078'000.00	0.08	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	3'400	1'000	0	4'400 CHF	101.75%	4'477'000.00	0.17	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	100.75%	1'712'750.00	0.06	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	5'000	100	4'900 CHF	103.60%	5'076'400.00	0.19	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290975528	1.9000 % KBFRIB 1.9 09/08/26	1'400	0	0	1'400 CHF	101.45%	1'420'300.00	0.05	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	103.30%	2'375'900.00	0.09	a)
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	0	975	0	975 CHF	100.80%	982'800.00	0.04	a)
CH1291601966	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28 MAY	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	103.00%	2'369'000.00	0.09	a)
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	1'400	0	0	1'400 CHF	102.95%	1'441'300.00	0.05	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	2'370	0	0	2'370 CHF	101.85%	2'413'845.00	0.09	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	3'520	0	0	3'520 CHF	101.80%	3'583'360.00	0.14	a)
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	2'580	0	100	2'480 CHF	103.10%	2'556'880.00	0.10	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	103.65%	2'591'250.00	0.10	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	2'960	290	0	3'250 CHF	102.35%	3'326'375.00	0.13	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	2'280	220	0	2'500 CHF	103.90%	2'597'500.00	0.10	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	2'290	0	0	2'290 CHF	104.00%	2'381'600.00	0.09	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	2'260	0	0	2'260 CHF	103.50%	2'339'100.00	0.09	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	2'700	400	1'000	2'100 CHF	103.75%	2'178'750.00	0.08	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	104.45%	3'551'300.00	0.13	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	103.60%	1'139'600.00	0.04	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	1'400	0	0	1'400 CHF	101.55%	1'421'700.00	0.05	a)
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	102.55%	1'128'050.00	0.04	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	4'010	0	0	4'010 CHF	105.55%	4'232'555.00	0.16	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	2'500	400	0	2'900 CHF	101.70%	2'949'300.00	0.11	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	3'450	0	0	3'450 CHF	101.35%	3'496'575.00	0.13	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	102.80%	1'336'400.00	0.05	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	3'700	300	0	4'000 CHF	103.50%	4'140'000.00	0.16	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	1'400	200	0	1'600 CHF	101.25%	1'620'000.00	0.06	a)
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	3'450	0	0	3'450 CHF	101.75%	3'510'375.00	0.13	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	800	500	0	1'300 CHF	102.15%	1'327'950.00	0.05	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	1'900	400	0	2'300 CHF	103.85%	2'388'550.00	0.09	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	2'270	0	0	2'270 CHF	101.80%	2'310'860.00	0.09	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	101.95%	1'733'150.00	0.07	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	1'500	500	0	2'000 CHF	102.50%	2'050'000.00	0.08	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	1'020	0	0	1'020 CHF	101.10%	1'031'220.00	0.04	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	2'550	3'300	0	5'850 CHF	101.19%	5'919'615.00	0.22	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLILJ 2 1/4 12/05/25	680	0	0	680 CHF	101.18%	688'024.00	0.03	a)
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	101.90%	1'120'900.00	0.04	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	2'200	200	2'000	400 CHF	101.40%	405'600.00	0.02	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	1'500	1'100	0	2'600 CHF	101.95%	2'650'700.00	0.10	a)
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	600	0	0	600 CHF	101.70%	610'200.00	0.02	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	2'200	0	0	2'200 CHF	103.70%	2'281'400.00	0.09	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	102.90%	2'058'000.00	0.08	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	3'300	200	0	3'500 CHF	101.75%	3'561'250.00	0.13	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	2'500	0	0	2'500 CHF	100.85%	2'521'250.00	0.10	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	2'460	380	0	2'840 CHF	103.10%	2'928'040.00	0.11	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	1'600	1'700	1'000	2'300 CHF	102.80%	2'364'400.00	0.09	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	2'100	480	0	2'580 CHF	104.20%	2'688'360.00	0.10	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	103.05%	2'576'250.00	0.10	a)
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	4'905	0	4'905 CHF	102.65%	5'034'982.50	0.19	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	2'505	290	100	2'695 CHF	102.00%	2'748'900.00	0.10	a)
CH1323274063	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 FEB	0	4'300	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	0	1'400	120	1'280 CHF	101.25%	1'296'000.00	0.05	a)
CH1325037021	1.7000 % DAESW 1.7 10/30/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.20%	1'533'000.00	0.06	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	1'700	0	1'700 CHF	100.70%	1'711'900.00	0.06	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	101.75%	3'663'000.00	0.14	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	103.50%	3'726'000.00	0.14	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	0	1'000	0	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.04	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	0	3'800	0	3'800 CHF	101.80%	3'868'400.00	0.15	a)
CH1331113501	2.3750 % CLNVX 2 3/8 03/30/27	0	2'160	0	2'160 CHF	101.85%	2'199'960.00	0.08	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	3'400	0	3'400 CHF	102.60%	3'488'400.00	0.13	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	2'300	0	2'300 CHF	100.75%	2'317'250.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1335850264	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 APR	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850306	2.8000 % UINT 2.8 07/23/27	0	1'600	0	1'600 CHF	100.67%	1'610'752.00	0.06 a)	
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	3'100	0	3'100 CHF	102.35%	3'172'850.00	0.12 a)	
CH1337248996	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 MAY	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034952	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 APR	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034994	1.4100 % SLHNVX 1.41 04/26/27	0	1'160	0	1'160 CHF	100.55%	1'166'380.00	0.04 a)	
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.40%	1'521'000.00	0.06 a)	
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28	0	3'800	0	3'800 CHF	101.30%	3'849'400.00	0.15 a)	
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	2'000	0	2'000 CHF	102.05%	2'041'000.00	0.08 a)	
CH1344316745	1.3750 % NESNVX 1 3/8 11/30/28	0	4'650	0	4'650 CHF	101.30%	4'710'450.00	0.18 a)	
CH1346742898	1.6500 % VISECA 1.65 06/06/28	0	2'000	0	2'000 CHF	101.50%	2'030'000.00	0.08 a)	
CH1346743060	1.7500 % COOPSW 1 3/4 07/17/28	0	3'500	0	3'500 CHF	101.95%	3'568'250.00	0.14 a)	
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	0	720	0	720 CHF	101.50%	730'800.00	0.03 a)	
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	101.45%	2'840'600.00	0.11 a)	
CH1348614046	1.8000 % BARY 1.8 05/15/26	0	1'600	0	1'600 CHF	100.70%	1'611'200.00	0.06 a)	
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	3'800	0	3'800 CHF	102.50%	3'895'000.00	0.15 a)	
CH1348614160	2.0975 % AGUAND 2.0975 05/30/29	0	1'300	0	1'300 CHF	102.30%	1'329'900.00	0.05 a)	
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	2'100	0	2'100 CHF	101.45%	2'130'450.00	0.08 a)	
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	1'300	0	1'300 CHF	100.61%	1'307'982.00	0.05 a)	
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	0	2'600	0	2'600 CHF	100.97%	2'625'220.00	0.10 a)	
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	0	2'500	0	2'500 CHF	103.25%	2'581'250.00	0.10 a)	
CH1353257806	1.6000 % NOVNVX 1.6 06/18/27	0	7'500	0	7'500 CHF	101.70%	7'627'500.00	0.29 a)	
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	4'400	0	4'400 CHF	101.46%	4'464'240.00	0.17 a)	
CH1353257913	1.9950 % EFGBNK 1.995 06/28/27	0	1'900	0	1'900 CHF	101.45%	1'927'550.00	0.07 a)	
CH1356197108	2.1500 % TRAGR 2.15 06/18/27 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	101.90%	2'445'600.00	0.09 a)	
CH1357852651	1.6925 % SRAIL 1.6925 07/12/29	0	1'100	0	1'100 CHF	101.30%	1'114'300.00	0.04 a)	
CH1357852677	1.3800 % IBESM 1.38 07/11/28 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	100.96%	1'817'334.00	0.07 a)	
CH1357852693	1.6500 % SPSNSW 1.65 07/16/29	0	2'200	0	2'200 CHF	101.25%	2'227'500.00	0.08 a)	
CH1357852735	1.4900 % HANWHA 1.49 08/06/27	0	1'355	0	1'355 CHF	100.49%	1'361'598.85	0.05 a)	
CH1357852784	1.4500 % IRENSW 1.45 10/16/26	0	1'300	0	1'300 CHF	100.02%	1'300'195.00	0.05 a)	
CH1361401701	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 JUL	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	0	1'820	0	1'820 CHF	101.25%	1'842'750.00	0.07 a)	
CHF							2'617'958'167.35	99.16	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'246'600.35	0.20
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'617'958'167.35	99.16
Sonstige Vermögenswerte	16'992'750.63	0.64
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'640'197'518.33	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-142'745.40	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'640'054'772.93	

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);	2'617'958'167.35	99.16
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

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.95251750
-----	---------	------------

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: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.34	-	0.134	-	-	-
FA CHF	CHF	0.00 - 0.34	-	0.134	-	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.34	-	0.134	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.34	-	0.134	-	-	-

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: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	-
FA CHF	0.160	0.500	0.060	0.100	-
GT CHF	0.130	0.350	0.080	0.050	-
NT CHF	-	-	-	-	-

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

SBI® AAA-BBB 1-5 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 Fussnoten

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der 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 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 all-fällige 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 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 Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen

anfallen;

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