

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 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»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
ASTT CHF	38329244	CHF
BVG 3 Index 45	38329242	CHF
DT CHF	38329248	CHF
FA CHF	21580464	CHF
GT CHF	38329251	CHF
NT CHF	21580466	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	30
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	31
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	31
7	Pauschale Verwaltungskommission	32
8	Benchmark	33
9	TER	33
10	Fussnoten	33
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	34

# 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
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'042'729'877.08	6'577'810'810.65	5'454'152'733.48	5'622'350'312.07
<b>Klasse ASTT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		258'590'037.41	249'743'217.14	235'934'459.58	245'458'482.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'583'121.323	2'584'296.849	2'548'189.921	2'419'872.612
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		100.1076	96.6388	92.5890	101.4345
Thesaurierung je Anteil		-	0.77	0.60	0.62
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse BVG 3 Index 45</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		145'993'349.73	136'871'033.69	140'264'593.83	162'380'783.02
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'514'166.165	1'466'275.860	1'559'410.758	1'638'373.643
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		96.4183	93.3460	89.9472	99.1110
Thesaurierung je Anteil		-	0.23	0.06	0.03
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.71 %	0.71 %	0.72 %	0.71 %
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		56'163'237.16	78'086'383.21	25'225'891.31	14'058'886.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		571'002.828	820'087.145	275'887.351	140'025.389
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		98.3589	95.2172	91.4355	100.4024
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		103.2621	102.1821	91.6365	96.1978
Thesaurierung je Anteil		-	0.76	0.60	0.62
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		205'339'671.97	188'848'795.90	113'176'002.02	128'521'779.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'279'706.678	2'155'461.190	1'330'418.705	1'378'513.686
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		90.0728	87.6141	85.0680	93.2321
Ausschüttung je Anteil		-	0.65	1.10	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		263'396'459.41	274'923'545.77	250'470'774.31	257'619'258.85
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'674'504.566	2'883'798.100	2'736'497.050	2'563'702.261
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		98.4842	95.3338	91.5297	100.4872
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		103.3936	102.3073	91.7309	96.2791
Thesaurierung je Anteil		-	0.79	0.62	0.65
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.11 %	0.11 %	0.11 %	0.11 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'113'247'121.40	5'649'337'834.94	4'689'081'012.43	4'814'311'121.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		62'409'374.798	59'589'783.613	51'553'331.640	48'244'762.899
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		97.9540	94.8038	90.9559	99.7893
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		102.8369	101.7385	91.1559	95.6104
Thesaurierung je Anteil		-	0.89	0.72	0.76
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

## Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse ASTT CHF	3.59 %	7.32 %	-11.98 %	-1.92 %
Klasse BVG 3 Index 45	3.29 %	6.70 %	-12.49 %	-2.47 %
Klasse DT CHF	3.59 %	7.32 %	-11.98 %	-1.92 %
Klasse FA CHF	3.57 %	7.28 %	-12.02 %	-1.96 %
Klasse GT CHF	3.61 %	7.35 %	-11.95 %	-1.89 %
Klasse NT CHF	3.66 %	7.47 %	-11.86 %	-1.78 %
Benchmark	3.56 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	-	0.07 %	0.14 %	0.04 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

## Tracking Differenz

### Klasse

Klasse ASTT CHF	0.03 %
Klasse BVG 3 Index 45	-0.27 %
Klasse DT CHF	0.03 %
Klasse FA CHF	0.01 %
Klasse GT CHF	0.05 %
Klasse NT CHF	0.10 %

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	17'259'520.69	27'706'286.81
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	5'525'848'445.45	5'190'297'628.95
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'459'814'017.98	1'322'196'384.83
Sonstige Vermögenswerte	39'994'925.96	37'783'962.64
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>7'042'916'910.08</b>	<b>6'577'984'263.23</b>
Andere Verbindlichkeiten	-187'033.00	-173'452.58
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>7'042'729'877.08</b>	<b>6'577'810'810.65</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
<b>Klasse ASTT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'584'296.849	2'548'189.921
Ausgegebene Anteile		1'340.573	44'552.263
Zurückgenommene Anteile		-2'516.099	-8'445.335
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'583'121.323</b>	<b>2'584'296.849</b>
<b>Klasse BVG 3 Index 45</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'466'275.860	1'559'410.758
Ausgegebene Anteile		56'351.013	22'216.861
Zurückgenommene Anteile		-8'460.708	-115'351.759
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'514'166.165</b>	<b>1'466'275.860</b>
<b>Klasse DT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		820'087.145	275'887.351
Ausgegebene Anteile		44'395.092	598'566.455
Zurückgenommene Anteile		-293'479.409	-54'366.661
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>571'002.828</b>	<b>820'087.145</b>
<b>Klasse FA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'155'461.190	1'330'418.705
Ausgegebene Anteile		298'537.184	1'204'981.361
Zurückgenommene Anteile		-174'291.696	-379'938.876
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'279'706.678</b>	<b>2'155'461.190</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'883'798.100	2'736'497.050
Ausgegebene Anteile		313'654.077	1'907'758.088
Zurückgenommene Anteile		-522'947.611	-1'760'457.038
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'674'504.566</b>	<b>2'883'798.100</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		59'589'783.613	51'553'331.640
Ausgegebene Anteile		4'410'973.344	9'890'748.686
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		545'622.066	2'678'624.191
Zurückgenommene Anteile		-2'137'004.225	-3'630'170.891
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-902'750.013
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>62'409'374.798</b>	<b>59'589'783.613</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	09.04.2024	6'176'161.12	64'507.502
Klasse NT CHF	21.05.2024	17'033'744.05	178'846.792
Klasse NT CHF	20.06.2024	1'161'355.30	12'106.594
Klasse NT CHF	25.07.2024	28'267'937.20	290'161.178

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		6'577'810'810.65	5'454'152'733.48
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'456'410.84	-1'681'408.92
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-20'427'887.36	-15'248'415.08
Saldo aus dem Anteilverkehr		240'619'793.68	863'871'140.30
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		246'183'570.95	276'716'760.87
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>7'042'729'877.08</b>	<b>6'577'810'810.65</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.02.2024 31.07.2024</b>	<b>01.02.2023 31.01.2024</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		135'918.34	130'362.89
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		28'719'509.31	48'345'564.43
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		15'852'564.90	10'608'365.75
Sonstige Erträge		-0.03	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'339'137.96	5'790'548.81
<b>Total Ertrag</b>		<b>46'047'130.48</b>	<b>64'874'841.88</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-6.40	0.00
Reglementarische Vergütungen		-1'058'785.92	-1'975'983.07
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'089'294.30	-2'980'921.92
<b>Total Aufwand</b>		<b>-2'148'086.62</b>	<b>-4'956'904.99</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>43'899'043.86</b>	<b>59'917'936.89</b>
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-23'462'503.95	-46'949'469.78
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		1'446'450.99	4'204'308.17
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>21'882'990.90</b>	<b>17'172'775.28</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		224'300'580.05	259'543'985.59
<b>Gesamterfolg</b>		<b>246'183'570.95</b>	<b>276'716'760.87</b>



## 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.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>5'525'848'445.45</b>	<b>78.46</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>5'525'848'445.45</b>	<b>78.46</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	70'719	1'300	0	72'019 CHF	112.45%	80'985'365.50	1.15	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	34'820	1'700	0	36'520 CHF	183.25%	66'922'900.00	0.95	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	58'438	3'900	2'000	60'338 CHF	126.00%	76'025'880.00	1.08	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	5'840	0	0	5'840 CHF	110.50%	6'453'200.00	0.09	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	6'550	0	6'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	14'350	0	0	14'350 CHF	110.75%	15'892'625.00	0.23	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	4'590	0	4'590	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	9'225	300	1'000	8'525 CHF	101.40%	8'644'350.00	0.12	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	10'240	0	0	10'240 CHF	101.54%	10'397'696.00	0.15	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'180	0	0	2'180 CHF	101.68%	2'216'624.00	0.03	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	7'490	0	0	7'490 CHF	108.90%	8'156'610.00	0.12	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	6'040	300	0	6'340 CHF	118.30%	7'500'220.00	0.11	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	2'700	0	0	2'700 CHF	102.20%	2'759'400.00	0.04	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	57'642	1'300	0	58'942 CHF	123.23%	72'634'226.60	1.03	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	12'480	300	0	12'780 CHF	103.45%	13'220'910.00	0.19	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'540	0	0	2'540 CHF	101.90%	2'588'260.00	0.04	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	3'110	0	0	3'110 CHF	115.55%	3'593'605.00	0.05	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	4'310	0	0	4'310 CHF	125.45%	5'406'895.00	0.08	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	101.74%	3'459'160.00	0.05	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	980	0	0	980 CHF	126.65%	1'241'170.00	0.02	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	2'440	0	0	2'440 CHF	110.95%	2'707'180.00	0.04	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN	4'300	0	0	4'300 CHF	114.80%	4'936'400.00	0.07	a)
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	1'510	0	0	1'510 CHF	112.85%	1'704'035.00	0.02	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	5'650	0	0	5'650 CHF	113.55%	6'415'575.00	0.09	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	8'050	0	8'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'420	0	0	1'420 CHF	120.10%	1'705'420.00	0.02	a)
CH0031226134	3.2500 % PSYPO 3 1/4 06/15/27 424	3'355	0	0	3'355 CHF	106.27%	3'565'358.50	0.05	a)
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	470	0	0	470 CHF	128.45%	603'715.00	0.01	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	38'678	1'800	0	40'478 CHF	107.63%	43'566'471.40	0.62	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	3'120	0	0	3'120 CHF	108.00%	3'369'600.00	0.05	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	4'200	0	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	2'690	0	2'690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	110.35%	3'089'800.00	0.04	a)
CH0111008048	2.6250 % PSYPO 2 5/8 03/27/30 512	2'975	0	0	2'975 CHF	108.82%	3'237'395.00	0.05	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	1'745	0	0	1'745 CHF	100.80%	1'758'960.00	0.02	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	3'400	0	0	3'400 CHF	105.05%	3'571'700.00	0.05	a)
CH0115967397	2.2500 % PSYPO 2 1/4 08/13/32 519	7'855	0	0	7'855 CHF	109.17%	8'575'303.50	0.12	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	3'820	0	0	3'820 CHF	100.91%	3'854'762.00	0.05	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	1'270	0	0	1'270 CHF	104.60%	1'328'420.00	0.02	a)
CH0117076379	1.8750 % PSYPO 1 7/8 09/15/31 524	12'505	0	0	12'505 CHF	105.70%	13'217'785.00	0.19	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	900	0	0	900 CHF	101.60%	914'400.00	0.01	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	103.10%	1'752'700.00	0.02	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	850	0	0	850 CHF	105.90%	900'150.00	0.01	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	1'520	0	0	1'520 CHF	101.95%	1'549'640.00	0.02	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	6'665	0	0	6'665 CHF	101.15%	6'741'647.50	0.10	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	225	0	0	225 CHF	106.90%	240'525.00	0.00	a)
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	930	0	0	930 CHF	111.50%	1'036'950.00	0.01	a)
CH0119542634	2.0000 % EIB 2 11/30/35	740	0	0	740 CHF	112.25%	830'650.00	0.01	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'740	300	0	3'040 CHF	108.35%	3'293'840.00	0.05	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	2'615	600	0	3'215 CHF	104.90%	3'372'535.00	0.05	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.
CH0119983077	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 11/26/35	2'000	0	0	2'000 CHF	107.25%	2'145'000.00	0.03	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	8'115	0	0	8'115 CHF	104.71%	8'497'216.50	0.12	a)
CH0120381592	2.0000 % KBLUZE 2 12/06/33	900	0	0	900 CHF	107.30%	965'700.00	0.01	a)
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	1'480	0	0	1'480 CHF	111.90%	1'656'120.00	0.02	a)
CH0120847899	2.1250 % SGKNSW 2 1/8 12/27/40	0	1'000	0	1'000 CHF	114.75%	1'147'500.00	0.02	a)
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	5'910	3'900	0	9'810 CHF	103.67%	10'170'027.00	0.14	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	12'575	0	0	12'575 CHF	110.06%	13'840'045.00	0.20	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'720	0	0	1'720 CHF	101.73%	1'749'756.00	0.02	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	109.30%	3'442'950.00	0.05	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	2'230	0	0	2'230 CHF	115.40%	2'573'420.00	0.04	a)
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	2'310	0	0	2'310 CHF	122.45%	2'828'595.00	0.04	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	2'650	0	0	2'650 CHF	102.20%	2'708'300.00	0.04	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	12'470	0	0	12'470 CHF	102.36%	12'764'292.00	0.18	a)
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	100	0	0	100 CHF	118.80%	118'800.00	0.00	a)
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	935	0	0	935 CHF	124.10%	1'160'335.00	0.02	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	4'520	0	0	4'520 CHF	102.20%	4'619'440.00	0.07	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	43'981	0	800	43'181 CHF	112.00%	48'362'720.00	0.69	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	55'057	1'650	1'000	55'707 CHF	118.39%	65'951'517.30	0.94	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	51'074	800	0	51'874 CHF	110.12%	57'123'648.80	0.81	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	4'775	0	0	4'775 CHF	102.16%	4'878'140.00	0.07	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	1'330	500	0	1'830 CHF	108.25%	1'980'975.00	0.03	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	1'420	0	0	1'420 CHF	110.30%	1'566'260.00	0.02	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	5'560	0	0	5'560 CHF	104.00%	5'782'400.00	0.08	a)
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	3'040	0	0	3'040 CHF	121.85%	3'704'240.00	0.05	a)
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	1'070	0	0	1'070 CHF	108.95%	1'165'765.00	0.02	a)
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	400	0	0	400 CHF	104.35%	417'400.00	0.01	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	2'000	0	0	2'000 CHF	101.75%	2'035'000.00	0.03	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	7'410	0	0	7'410 CHF	101.47%	7'518'927.00	0.11	a)
CH0137992803	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41	1'600	1'600	0	3'200 CHF	113.95%	3'646'400.00	0.05	a)
CH0138276859	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 10/04/41	1'250	0	0	1'250 CHF	114.90%	1'436'250.00	0.02	a)
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'120	0	0	1'120 CHF	100.72%	1'128'064.00	0.02	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	2'680	0	2'680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	2'280	0	0	2'280 CHF	102.00%	2'325'600.00	0.03	a)
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	1'530	0	0	1'530 CHF	116.15%	1'777'095.00	0.03	a)
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	650	0	0	650 CHF	100.75%	654'875.00	0.01	a)
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	4'580	0	0	4'580 CHF	108.25%	4'957'850.00	0.07	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	3'300	0	0	3'300 CHF	100.90%	3'329'700.00	0.05	a)
CH0143808365	1.5000 % BVZNSW 1 1/2 04/12/32	1'200	0	0	1'200 CHF	104.05%	1'248'600.00	0.02	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	7'170	6'000	0	13'170 CHF	101.64%	13'385'988.00	0.19	a)
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	4'550	0	0	4'550 CHF	105.58%	4'803'890.00	0.07	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	5'060	0	0	5'060 CHF	104.65%	5'295'290.00	0.08	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'790	0	0	1'790 CHF	100.95%	1'807'005.00	0.03	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.15%	5'057'500.00	0.07	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	11'200	0	0	11'200 CHF	100.89%	11'299'680.00	0.16	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	3'200	0	0	3'200 CHF	104.85%	3'355'200.00	0.05	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'850	0	0	1'850 CHF	101.05%	1'869'425.00	0.03	a)
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	1'380	0	0	1'380 CHF	110.20%	1'520'760.00	0.02	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	1'355	0	0	1'355 CHF	101.30%	1'372'615.00	0.02	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	6'000	0	0	6'000 CHF	102.18%	6'130'800.00	0.09	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	11'810	0	0	11'810 CHF	101.28%	11'961'168.00	0.17	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	46'820	300	10'000	37'120 CHF	100.61%	37'346'432.00	0.53	a)
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	1'520	0	0	1'520 CHF	104.65%	1'590'680.00	0.02	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	3'075	0	0	3'075 CHF	101.60%	3'124'200.00	0.04	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	9'020	0	1'000	8'020 CHF	102.23%	8'198'846.00	0.12	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	1'490	0	0	1'490 CHF	100.80%	1'501'920.00	0.02	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	1'000	0	0	1'000 CHF	103.90%	1'039'000.00	0.01	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'630	0	0	1'630 CHF	101.15%	1'648'745.00	0.02	a)
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'835	0	0	2'835 CHF	101.30%	2'871'855.00	0.04	a)
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	2'070	500	0	2'570 CHF	100.80%	2'590'560.00	0.04	a)
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	2'900	0	0	2'900 CHF	105.15%	3'049'350.00	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.
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	3'200	500	0	3'700 CHF	101.20%	3'744'400.00	0.05	a)
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	10'270	0	0	10'270 CHF	103.70%	10'649'990.00	0.15	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	4'825	0	0	4'825 CHF	101.05%	4'875'662.50	0.07	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	2'970	0	0	2'970 CHF	101.05%	3'001'185.00	0.04	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	11'700	300	0	12'000 CHF	101.79%	12'214'800.00	0.17	a)
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	2'500	0	0	2'500 CHF	100.65%	2'516'250.00	0.04	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	2'020	780	0	2'800 CHF	104.30%	2'920'400.00	0.04	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'420	0	0	1'420 CHF	101.85%	1'446'270.00	0.02	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	3'270	0	1'000	2'270 CHF	100.06%	2'271'362.00	0.03	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	3'000	0	0	3'000 CHF	103.35%	3'100'500.00	0.04	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	3'950	0	0	3'950 CHF	100.75%	3'979'625.00	0.06	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	4'350	0	0	4'350 CHF	103.65%	4'508'775.00	0.06	a)
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	2'240	0	0	2'240 CHF	104.80%	2'347'520.00	0.03	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	1'860	300	0	2'160 CHF	101.10%	2'183'760.00	0.03	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	6'550	0	0	6'550 CHF	101.15%	6'625'325.00	0.09	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	1'250	0	0	1'250 CHF	102.15%	1'276'875.00	0.02	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	4'260	300	0	4'560 CHF	101.95%	4'648'920.00	0.07	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	2'700	0	0	2'700 CHF	103.05%	2'782'350.00	0.04	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	1'240	0	0	1'240 CHF	109.75%	1'360'900.00	0.02	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	2'300	0	0	2'300 CHF	102.15%	2'349'450.00	0.03	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	3'820	0	3'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	2'255	0	0	2'255 CHF	101.00%	2'277'550.00	0.03	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	2'320	0	0	2'320 CHF	112.10%	2'600'720.00	0.04	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	1'540	0	0	1'540 CHF	101.80%	1'567'720.00	0.02	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	2'050	0	0	2'050 CHF	107.10%	2'195'550.00	0.03	a)
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	4'880	0	1'000	3'880 CHF	105.80%	4'105'040.00	0.06	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'550	0	250	1'300 CHF	102.00%	1'326'000.00	0.02	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	12'125	0	0	12'125 CHF	103.45%	12'543'312.50	0.18	a)
CH0212114653	1.8000 % TESSIN 1.8 05/15/43	1'110	0	0	1'110 CHF	114.10%	1'266'510.00	0.02	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	1'870	0	0	1'870 CHF	107.60%	2'012'120.00	0.03	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	2'370	0	2'370	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	1'080	0	0	1'080 CHF	110.45%	1'192'860.00	0.02	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	2'580	0	0	2'580 CHF	102.50%	2'644'500.00	0.04	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	2'470	0	0	2'470 CHF	114.55%	2'829'385.00	0.04	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	4'500	0	0	4'500 CHF	101.81%	4'581'450.00	0.07	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	3'010	0	0	3'010 CHF	107.80%	3'244'780.00	0.05	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	1'540	0	0	1'540 CHF	103.40%	1'592'360.00	0.02	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	10'100	300	8'400	2'000 CHF	100.62%	2'012'400.00	0.03	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	3'030	400	0	3'430 CHF	103.50%	3'550'050.00	0.05	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	2'140	0	0	2'140 CHF	113.90%	2'437'460.00	0.03	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	2'840	0	0	2'840 CHF	101.45%	2'881'180.00	0.04	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	3'380	0	0	3'380 CHF	114.95%	3'885'310.00	0.06	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	7'550	0	0	7'550 CHF	101.05%	7'629'275.00	0.11	a)
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'000	0	0	1'000 CHF	110.90%	1'109'000.00	0.02	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	2'940	0	0	2'940 CHF	101.60%	2'987'040.00	0.04	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	3'710	0	0	3'710 CHF	106.75%	3'960'425.00	0.06	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	48'110	300	0	48'410 CHF	101.08%	48'932'828.00	0.69	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	41'980	1'400	0	43'380 CHF	165.00%	71'577'000.00	1.02	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	45'677	4'900	2'850	47'727 CHF	99.96%	47'707'909.20	0.68	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	26'830	3'200	0	30'030 CHF	104.69%	31'438'407.00	0.45	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	60'660	4'300	850	64'110 CHF	97.38%	62'430'318.00	0.89	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	5'680	0	0	5'680 CHF	109.95%	6'245'160.00	0.09	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	600	0	0	600 CHF	109.85%	659'100.00	0.01	a)
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	1'090	0	0	1'090 CHF	100.65%	1'097'085.00	0.02	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228138274	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/38	700	0	0	700 CHF	113.50%	794'500.00	0.01	a)
CH0228138282	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/43	1'300	0	0	1'300 CHF	118.80%	1'544'400.00	0.02	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	250	0	0	250 CHF	119.45%	298'625.00	0.00	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	1'850	4'100	0	5'950 CHF	109.45%	6'512'275.00	0.09	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	3'100	0	0	3'100 CHF	117.20%	3'633'200.00	0.05	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.
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	830	0	0	830 CHF	116.95%	970'685.00	0.01	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	2'940	0	2'940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	10'330	0	0	10'330 CHF	101.07%	10'440'531.00	0.15	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	400	0	0	400 CHF	104.00%	416'000.00	0.01	a)
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	2'095	0	0	2'095 CHF	119.11%	2'495'354.50	0.04	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	2'210	0	0	2'210 CHF	100.55%	2'222'155.00	0.03	a)
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	7'820	0	0	7'820 CHF	100.60%	7'866'920.00	0.11	a)
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	750	0	0	750 CHF	102.55%	769'125.00	0.01	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	6'900	0	0	6'900 CHF	102.10%	7'044'900.00	0.10	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	3'700	0	0	3'700 CHF	103.35%	3'823'950.00	0.05	a)
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	2'480	0	0	2'480 CHF	100.05%	2'481'240.00	0.04	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	104.35%	1'043'500.00	0.01	a)
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'845	0	0	1'845 CHF	102.20%	1'885'590.00	0.03	a)
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'920	300	0	3'220 CHF	100.35%	3'231'270.00	0.05	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	5'650	0	0	5'650 CHF	105.35%	5'952'275.00	0.08	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	2'130	0	0	2'130 CHF	101.35%	2'158'755.00	0.03	a)
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	100.35%	2'809'800.00	0.04	a)
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'890	0	0	1'890 CHF	100.35%	1'896'615.00	0.03	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	1'320	0	0	1'320 CHF	101.40%	1'338'480.00	0.02	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	4'230	0	0	4'230 CHF	100.45%	4'249'035.00	0.06	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	7'450	0	0	7'450 CHF	99.92%	7'444'040.00	0.11	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	11'050	0	0	11'050 CHF	102.45%	11'320'725.00	0.16	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	98.50%	1'822'250.00	0.03	a)
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	2'570	0	0	2'570 CHF	104.01%	2'673'057.00	0.04	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	5'060	4'000	0	9'060 CHF	101.32%	9'179'592.00	0.13	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	3'250	0	0	3'250 CHF	100.20%	3'256'500.00	0.05	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	760	0	760	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	2'535	0	2'535	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	4'895	1'400	0	6'295 CHF	105.85%	6'663'257.50	0.09	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	4'150	0	0	4'150 CHF	98.45%	4'085'675.00	0.06	a)
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	15'410	300	0	15'710 CHF	99.90%	15'694'290.00	0.22	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	11'950	0	11'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	5'180	0	5'180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	2'330	0	0	2'330 CHF	98.50%	2'295'050.00	0.03	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	9'960	0	0	9'960 CHF	96.60%	9'621'360.00	0.14	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	3'030	0	0	3'030 CHF	98.75%	2'992'125.00	0.04	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	1'100	0	0	1'100 CHF	97.05%	1'067'550.00	0.02	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	1'990	0	0	1'990 CHF	96.75%	1'925'325.00	0.03	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	8'950	0	0	8'950 CHF	97.81%	8'753'995.00	0.12	a)
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	2'380	0	0	2'380 CHF	98.05%	2'333'590.00	0.03	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	940	0	0	940 CHF	97.95%	920'730.00	0.01	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	1'820	0	0	1'820 CHF	97.10%	1'767'220.00	0.03	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	2'360	0	0	2'360 CHF	97.75%	2'306'900.00	0.03	a)
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	3'010	0	0	3'010 CHF	102.15%	3'074'715.00	0.04	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	3'550	300	0	3'850 CHF	98.55%	3'794'175.00	0.05	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	1'130	300	0	1'430 CHF	98.15%	1'403'545.00	0.02	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	7'610	1'500	0	9'110 CHF	98.11%	8'937'821.00	0.13	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	8'000	0	0	8'000 CHF	97.61%	7'808'800.00	0.11	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	910	1'400	0	2'310 CHF	98.30%	2'270'730.00	0.03	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'120	0	0	1'120 CHF	101.15%	1'132'880.00	0.02	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	10'220	0	10'220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	9'280	0	0	9'280 CHF	98.10%	9'103'680.00	0.13	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27	1'700	0	0	1'700 CHF	98.45%	1'673'650.00	0.02	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	5'900	0	1'500	4'400 CHF	98.70%	4'342'800.00	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.
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'400	0	0	1'400 CHF	98.10%	1'373'400.00	0.02	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'720	0	500	2'220 CHF	97.80%	2'171'160.00	0.03	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	7'340	0	500	6'840 CHF	96.40%	6'593'760.00	0.09	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'530	0	1'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	9'120	0	0	9'120 CHF	97.15%	8'860'080.00	0.13	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'920	0	1'920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	2'820	0	750	2'070 CHF	97.20%	2'012'040.00	0.03	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	9'850	0	500	9'350 CHF	95.83%	8'960'105.00	0.13	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	3'140	0	3'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	2'450	300	0	2'750 CHF	97.25%	2'674'375.00	0.04	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	1'485	0	1'485	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	4'380	0	0	4'380 CHF	96.92%	4'245'096.00	0.06	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	4'930	3'400	0	8'330 CHF	99.22%	8'265'026.00	0.12	a)
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	1'590	0	0	1'590 CHF	99.45%	1'581'255.00	0.02	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	4'550	500	5'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	13'100	0	13'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	8'825	0	0	8'825 CHF	99.55%	8'785'287.50	0.12	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	6'565	0	0	6'565 CHF	100.01%	6'565'656.50	0.09	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	1'800	0	500	1'300 CHF	99.52%	1'293'760.00	0.02	a)
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	590	2'400	0	2'990 CHF	102.80%	3'073'720.00	0.04	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	2'190	350	0	2'540 CHF	99.00%	2'514'600.00	0.04	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	8'380	0	0	8'380 CHF	98.83%	8'281'954.00	0.12	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	2'125	900	1'525	1'500 CHF	99.58%	1'493'700.00	0.02	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	9'750	300	2'000	8'050 CHF	99.45%	8'005'725.00	0.11	a)
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	1'000	0	0	1'000 CHF	99.48%	994'800.00	0.01	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	7'700	0	0	7'700 CHF	99.01%	7'623'770.00	0.11	a)
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	300	0	0	300 CHF	97.90%	293'700.00	0.00	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	10'500	0	0	10'500 CHF	97.26%	10'212'300.00	0.15	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNWSW 0.4 09/15/25	2'550	500	1'000	2'050 CHF	99.05%	2'030'525.00	0.03	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	7'120	0	0	7'120 CHF	99.30%	7'070'160.00	0.10	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	6'540	0	0	6'540 CHF	99.19%	6'487'026.00	0.09	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	6'650	0	0	6'650 CHF	98.77%	6'568'205.00	0.09	a)
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	2'430	0	0	2'430 CHF	97.65%	2'372'895.00	0.03	a)
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	2'620	0	0	2'620 CHF	97.85%	2'563'670.00	0.04	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	7'265	1'500	0	8'765 CHF	99.33%	8'706'274.50	0.12	a)
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	8'250	0	0	8'250 CHF	97.47%	8'041'275.00	0.11	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	98.84%	2'471'000.00	0.04	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	9'650	0	1'000	8'650 CHF	97.56%	8'438'940.00	0.12	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	3'230	0	3'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	3'245	1'000	0	4'245 CHF	97.70%	4'147'365.00	0.06	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	3'040	0	0	3'040 CHF	97.90%	2'976'160.00	0.04	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	7'720	0	0	7'720 CHF	96.55%	7'453'660.00	0.11	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.15%	1'963'000.00	0.03	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	5'500	0	0	5'500 CHF	98.62%	5'424'100.00	0.08	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	800	500	0	1'300 CHF	97.80%	1'271'400.00	0.02	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	1'900	0	0	1'900 CHF	96.85%	1'840'150.00	0.03	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	7'080	0	0	7'080 CHF	98.58%	6'979'464.00	0.10	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	11'890	0	0	11'890 CHF	96.85%	11'515'465.00	0.16	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	500	0	0	500 CHF	99.80%	499'000.00	0.01	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	5'295	0	0	5'295 CHF	101.05%	5'350'597.50	0.08	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	7'540	0	0	7'540 CHF	97.31%	7'337'174.00	0.10	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	10'190	0	0	10'190 CHF	94.52%	9'631'588.00	0.14	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	10'640	300	0	10'940 CHF	98.45%	10'770'430.00	0.15	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	98.51%	2'364'240.00	0.03	a)
CH0310646523	0.5000 % KBFRI 0 1/2 02/23/28	5'780	300	700	5'380 CHF	97.70%	5'256'260.00	0.07	a)
CH0311427618	0.2000 % WKBNWSW 0.2 08/19/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	2'800	0	0	2'800 CHF	97.20%	2'721'600.00	0.04	a)
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	7'120	0	0	7'120 CHF	94.48%	6'726'976.00	0.10	a)
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	2'780	0	0	2'780 CHF	93.95%	2'611'810.00	0.04	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'720	0	0	1'720 CHF	98.60%	1'695'920.00	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.
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	4'270	300	0	4'570 CHF	94.05%	4'298'085.00	0.06	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	11'120	0	0	11'120 CHF	97.83%	10'878'696.00	0.15	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	4'850	0	0	4'850 CHF	98.10%	4'757'850.00	0.07	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	650	0	0	650 CHF	98.20%	638'300.00	0.01	a)
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	10'840	300	0	11'140 CHF	95.08%	10'591'912.00	0.15	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	10'260	0	0	10'260 CHF	96.44%	9'894'744.00	0.14	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	8'270	0	0	8'270 CHF	95.10%	7'864'770.00	0.11	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	9'210	0	0	9'210 CHF	93.46%	8'607'666.00	0.12	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	5'700	0	5'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	350	600	0	950 CHF	97.80%	929'100.00	0.01	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	2'210	0	0	2'210 CHF	95.00%	2'099'500.00	0.03	a)
CH0319932767	0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31	1'100	0	0	1'100 CHF	94.45%	1'038'950.00	0.01	a)
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	700	0	0	700 CHF	94.65%	662'550.00	0.01	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	7'310	0	0	7'310 CHF	97.05%	7'094'355.00	0.10	a)
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	6'040	0	0	6'040 CHF	93.80%	5'665'520.00	0.08	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'155	0	0	1'155 CHF	95.90%	1'107'645.00	0.02	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	7'410	300	0	7'710 CHF	90.05%	6'942'855.00	0.10	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	4'050	0	2'000	2'050 CHF	99.05%	2'030'525.00	0.03	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'530	0	0	2'530 CHF	89.95%	2'275'735.00	0.03	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'150	0	0	2'150 CHF	96.85%	2'082'275.00	0.03	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	8'090	0	0	8'090 CHF	89.07%	7'205'763.00	0.10	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	2'060	0	750	1'310 CHF	98.87%	1'295'197.00	0.02	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	350	0	0	350 CHF	94.40%	330'400.00	0.00	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	800	0	0	800 CHF	98.20%	785'600.00	0.01	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	2'990	0	0	2'990 CHF	96.15%	2'874'885.00	0.04	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	8'830	0	2'000	6'830 CHF	93.81%	6'407'223.00	0.09	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	4'050	500	0	4'550 CHF	87.60%	3'985'800.00	0.06	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	6'860	0	0	6'860 CHF	86.59%	5'940'074.00	0.08	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	870	0	0	870 CHF	97.70%	849'990.00	0.01	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	10'710	0	0	10'710 CHF	97.48%	10'440'108.00	0.15	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	13'630	0	0	13'630 CHF	93.67%	12'767'221.00	0.18	a)
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	2'950	0	0	2'950 CHF	92.45%	2'727'275.00	0.04	a)
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	0	2'960	0	2'960 CHF	98.96%	2'929'216.00	0.04	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	8'650	0	0	8'650 CHF	97.81%	8'460'565.00	0.12	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	8'250	1'500	0	9'750 CHF	92.59%	9'027'525.00	0.13	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	7'790	300	0	8'090 CHF	87.90%	7'111'110.00	0.10	a)
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	5'020	800	0	5'820 CHF	97.85%	5'694'870.00	0.08	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	7'780	0	0	7'780 CHF	90.07%	7'007'446.00	0.10	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	3'760	0	500	3'260 CHF	95.85%	3'124'710.00	0.04	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	1'400	0	0	1'400 CHF	97.25%	1'361'500.00	0.02	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	3'350	0	0	3'350 CHF	89.80%	3'008'300.00	0.04	a)
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	4'235	0	0	4'235 CHF	88.45%	3'745'857.50	0.05	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	3'590	0	0	3'590 CHF	97.55%	3'502'045.00	0.05	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	2'270	0	0	2'270 CHF	88.10%	1'999'870.00	0.03	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	3'500	0	0	3'500 CHF	94.10%	3'293'500.00	0.05	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	5'500	0	0	5'500 CHF	93.85%	5'161'750.00	0.07	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	10'960	0	10'960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	11'120	0	11'120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	6'500	0	0	6'500 CHF	97.35%	6'327'750.00	0.09	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	1'400	0	0	1'400 CHF	96.70%	1'353'800.00	0.02	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	250	0	0	250 CHF	97.10%	242'750.00	0.00	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	1'650	0	400	1'250 CHF	97.65%	1'220'625.00	0.02	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	38'870	800	1'500	38'170 CHF	103.07%	39'341'819.00	0.56	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	41'770	6'290	0	48'060 CHF	101.17%	48'622'302.00	0.69	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	39'340	5'300	2'000	42'640 CHF	100.10%	42'682'640.00	0.61	a)
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	11'800	0	0	11'800 CHF	98.77%	11'654'860.00	0.17	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	3'260	0	0	3'260 CHF	97.85%	3'189'910.00	0.05	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	2'100	0	0	2'100 CHF	97.40%	2'045'400.00	0.03	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	3'900	0	0	3'900 CHF	96.55%	3'765'450.00	0.05	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	98.74%	1'876'060.00	0.03	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.
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	9'360	0	9'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	7'250	0	0	7'250 CHF	97.72%	7'084'700.00	0.10 a)	
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	8'715	0	0	8'715 CHF	94.17%	8'206'915.50	0.12 a)	
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	2'800	0	0	2'800 CHF	96.40%	2'699'200.00	0.04 a)	
CH0352595851	0.2000 % WKBNSW 0.2 02/02/26	3'900	0	0	3'900 CHF	98.42%	3'838'380.00	0.05 a)	
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	13'350	0	0	13'350 CHF	98.05%	13'089'675.00	0.19 a)	
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	11'140	0	0	11'140 CHF	95.95%	10'688'830.00	0.15 a)	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	300	0	300 CHF	99.05%	297'150.00	0.00 a)	
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	2'150	0	0	2'150 CHF	97.30%	2'091'950.00	0.03 a)	
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	4'600	0	0	4'600 CHF	97.27%	4'474'420.00	0.06 a)	
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'240	0	0	1'240 CHF	96.80%	1'200'320.00	0.02 a)	
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	5'990	300	0	6'290 CHF	97.80%	6'151'620.00	0.09 a)	
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	1'330	0	1'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	1'050	0	0	1'050 CHF	98.20%	1'031'100.00	0.01 a)	
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	2'790	0	0	2'790 CHF	98.35%	2'743'965.00	0.04 a)	
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	9'880	0	0	9'880 CHF	98.48%	9'729'824.00	0.14 a)	
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	14'510	300	0	14'810 CHF	97.33%	14'414'573.00	0.20 a)	
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	650	0	0	650 CHF	98.64%	641'160.00	0.01 a)	
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	1'800	0	0	1'800 CHF	95.70%	1'722'600.00	0.02 a)	
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	6'500	0	200	6'300 CHF	97.80%	6'161'400.00	0.09 a)	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	12'280	300	0	12'580 CHF	98.12%	12'343'496.00	0.18 a)	
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	6'650	0	0	6'650 CHF	98.10%	6'523'650.00	0.09 a)	
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	0	4'500	0	4'500 CHF	99.05%	4'457'250.00	0.06 a)	
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	11'580	0	0	11'580 CHF	97.94%	11'341'452.00	0.16 a)	
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	4'450	0	0	4'450 CHF	97.55%	4'340'975.00	0.06 a)	
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	7'680	0	0	7'680 CHF	98.58%	7'570'944.00	0.11 a)	
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'250	0	0	1'250 CHF	96.20%	1'202'500.00	0.02 a)	
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	5'830	0	0	5'830 CHF	98.93%	5'767'619.00	0.08 a)	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'590	0	0	2'590 CHF	94.75%	2'454'025.00	0.03 a)	
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	1'820	0	0	1'820 CHF	95.05%	1'729'910.00	0.02 a)	
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	2'150	0	0	2'150 CHF	96.95%	2'084'425.00	0.03 a)	
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	2'370	0	500	1'870 CHF	97.75%	1'827'925.00	0.03 a)	
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	1'340	0	0	1'340 CHF	98.35%	1'317'890.00	0.02 a)	
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	2'325	1'000	3'325	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'900	0	0	1'900 CHF	97.10%	1'844'900.00	0.03 a)	
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	1'100	0	0	1'100 CHF	95.45%	1'049'950.00	0.01 a)	
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	5'150	0	0	5'150 CHF	95.22%	4'903'830.00	0.07 a)	
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	3'360	0	0	3'360 CHF	95.40%	3'205'440.00	0.05 a)	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	4'600	800	800	4'600 CHF	96.35%	4'432'100.00	0.06 a)	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'800	0	0	1'800 CHF	97.35%	1'752'300.00	0.02 a)	
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	1'700	0	500	1'200 CHF	96.60%	1'159'200.00	0.02 a)	
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	1'200	0	0	1'200 CHF	99.45%	1'193'400.00	0.02 a)	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	300	0	300 CHF	98.89%	296'670.00	0.00 a)	
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	3'570	0	1'000	2'570 CHF	99.01%	2'544'557.00	0.04 a)	
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	8'200	0	0	8'200 CHF	98.29%	8'059'780.00	0.11 a)	
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	2'800	0	0	2'800 CHF	92.95%	2'602'600.00	0.04 a)	
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	3'730	0	1'800	1'930 CHF	96.45%	1'861'485.00	0.03 a)	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	12'450	0	0	12'450 CHF	97.48%	12'136'260.00	0.17 a)	
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	900	0	0	900 CHF	96.65%	869'850.00	0.01 a)	
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	8'190	300	0	8'490 CHF	97.45%	8'273'505.00	0.12 a)	
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	3'330	0	0	3'330 CHF	96.85%	3'225'105.00	0.05 a)	
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	4'430	0	0	4'430 CHF	97.35%	4'312'605.00	0.06 a)	
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	1'700	0	400	1'300 CHF	96.55%	1'255'150.00	0.02 a)	
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	12'130	300	0	12'430 CHF	98.05%	12'187'615.00	0.17 a)	
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	5'570	0	0	5'570 CHF	96.50%	5'375'050.00	0.08 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.
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	3'000	0	700	2'300 CHF	98.65%	2'268'950.00	0.03	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	3'250	0	3'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	11'700	0	0	11'700 CHF	97.85%	11'448'450.00	0.16	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	1'610	0	0	1'610 CHF	99.10%	1'595'510.00	0.02	a)
CH0373476784	0.5000 % KBBSH 0 1/2 05/31/28	1'700	600	0	2'300 CHF	97.65%	2'245'950.00	0.03	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	5'950	0	5'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	1'620	0	1'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	5'460	0	0	5'460 CHF	97.17%	5'305'482.00	0.08	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'150	0	0	2'150 CHF	97.55%	2'097'325.00	0.03	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'060	0	0	2'060 CHF	99.03%	2'040'018.00	0.03	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	3'270	0	0	3'270 CHF	96.30%	3'149'010.00	0.04	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	12'120	0	0	12'120 CHF	97.59%	11'827'908.00	0.17	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	3'350	0	3'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'200	0	0	1'200 CHF	98.79%	1'185'480.00	0.02	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	6'200	300	2'500	4'000 CHF	98.05%	3'922'000.00	0.06	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	2'540	0	0	2'540 CHF	95.25%	2'419'350.00	0.03	a)
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	1'890	0	0	1'890 CHF	95.85%	1'811'565.00	0.03	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	11'240	300	0	11'540 CHF	98.37%	11'351'898.00	0.16	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	6'600	0	0	6'600 CHF	97.55%	6'438'300.00	0.09	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	2'535	0	0	2'535 CHF	95.20%	2'413'320.00	0.03	a)
CH0385997116	0.7000 % NEUNBG 0.7 11/23/37	900	0	0	900 CHF	96.15%	865'350.00	0.01	a)
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	1'710	0	0	1'710 CHF	94.95%	1'623'645.00	0.02	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	2'400	1'000	0	3'400 CHF	97.60%	3'318'400.00	0.05	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	5'740	300	0	6'040 CHF	97.95%	5'916'180.00	0.08	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	2'100	0	0	2'100 CHF	97.25%	2'042'250.00	0.03	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	560	0	0	560 CHF	98.54%	551'824.00	0.01	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	1'120	0	0	1'120 CHF	97.30%	1'089'760.00	0.02	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	3'100	0	0	3'100 CHF	98.77%	3'061'870.00	0.04	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	3'150	0	2'000	1'150 CHF	100.23%	1'152'645.00	0.02	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	3'480	0	0	3'480 CHF	97.35%	3'387'780.00	0.05	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	10'200	0	0	10'200 CHF	98.64%	10'061'280.00	0.14	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	1'230	0	0	1'230 CHF	97.15%	1'194'945.00	0.02	a)
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	1'840	0	0	1'840 CHF	98.92%	1'820'128.00	0.03	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	1'550	800	0	2'350 CHF	97.85%	2'299'475.00	0.03	a)
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	3'900	0	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633336	0.3500 % WKBSNW 0.35 09/07/27	2'000	0	0	2'000 CHF	97.35%	1'947'000.00	0.03	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	2'770	0	700	2'070 CHF	98.25%	2'033'775.00	0.03	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	5'900	0	0	5'900 CHF	98.49%	5'810'910.00	0.08	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	7'780	0	0	7'780 CHF	97.49%	7'584'722.00	0.11	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	11'380	300	0	11'680 CHF	98.34%	11'486'112.00	0.16	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	410	0	0	410 CHF	98.45%	403'645.00	0.01	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	1'390	0	0	1'390 CHF	98.95%	1'375'405.00	0.02	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'000	0	0	2'000 CHF	97.70%	1'954'000.00	0.03	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	4'920	0	0	4'920 CHF	94.25%	4'637'100.00	0.07	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	1'520	0	0	1'520 CHF	91.35%	1'388'520.00	0.02	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	4'250	0	4'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	2'500	0	0	2'500 CHF	98.50%	2'462'500.00	0.03	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	5'470	300	0	5'770 CHF	98.10%	5'660'370.00	0.08	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	750	0	0	750 CHF	100.50%	753'750.00	0.01	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	98.82%	3'112'830.00	0.04	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'540	0	0	1'540 CHF	97.85%	1'506'890.00	0.02	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	1'900	0	0	1'900 CHF	97.60%	1'854'400.00	0.03	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	1'110	0	1'110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	2'440	0	0	2'440 CHF	98.40%	2'400'960.00	0.03	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	2'850	0	0	2'850 CHF	98.75%	2'814'375.00	0.04	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKKB 0.2 03/28/25	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	1'110	0	0	1'110 CHF	97.70%	1'084'470.00	0.02	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	4'000	500	1'200	3'300 CHF	97.85%	3'229'050.00	0.05	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	3'830	0	3'830	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.
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	4'470	1'300	0	5'770 CHF	97.70%	5'637'290.00	0.08	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	2'500	0	0	2'500 CHF	97.55%	2'438'750.00	0.03	a)
CH0419040735	0.3000 % WKBSNW 0.3 02/01/27	1'800	0	0	1'800 CHF	97.70%	1'758'600.00	0.02	a)
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	3'990	0	0	3'990 CHF	98.05%	3'912'195.00	0.06	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	4'600	300	0	4'900 CHF	97.45%	4'775'050.00	0.07	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	1'700	0	0	1'700 CHF	96.90%	1'647'300.00	0.02	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	14'850	0	0	14'850 CHF	96.87%	14'385'195.00	0.20	a)
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	900	0	0	900 CHF	97.05%	873'450.00	0.01	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	1'700	0	0	1'700 CHF	101.25%	1'721'250.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	11'350	0	0	11'350 CHF	96.70%	10'975'450.00	0.16	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	5'310	0	0	5'310 CHF	94.40%	5'012'640.00	0.07	a)
CH0419040974	0.8500 % KBLUZE 0.85 03/12/42	2'800	0	0	2'800 CHF	94.85%	2'655'800.00	0.04	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	0	5'370	0	5'370 CHF	99.85%	5'361'945.00	0.08	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'600	0	0	2'600 CHF	97.45%	2'533'700.00	0.04	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'330	0	0	1'330 CHF	98.60%	1'311'380.00	0.02	a)
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	780	0	0	780 CHF	98.85%	771'030.00	0.01	a)
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	1'200	1'000	0	2'200 CHF	98.00%	2'156'000.00	0.03	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	4'330	300	0	4'630 CHF	95.55%	4'423'965.00	0.06	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	1'440	0	0	1'440 CHF	95.45%	1'374'480.00	0.02	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	7'400	0	0	7'400 CHF	95.92%	7'098'080.00	0.10	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	7'000	0	0	7'000 CHF	94.55%	6'618'500.00	0.09	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	1'260	0	0	1'260 CHF	94.60%	1'191'960.00	0.02	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	3'645	0	1'500	2'145 CHF	95.55%	2'049'547.50	0.03	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	1'060	650	0	1'710 CHF	90.80%	1'552'680.00	0.02	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	4'820	0	0	4'820 CHF	94.20%	4'540'440.00	0.06	a)
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	2'900	0	0	2'900 CHF	88.20%	2'557'800.00	0.04	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	2'050	0	0	2'050 CHF	89.00%	1'824'500.00	0.03	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'420	0	0	1'420 CHF	94.45%	1'341'190.00	0.02	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	3'500	0	0	3'500 CHF	86.25%	3'018'750.00	0.04	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'700	0	0	1'700 CHF	81.25%	1'381'250.00	0.02	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	800	0	0	800 CHF	82.30%	658'400.00	0.01	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	4'700	0	0	4'700 CHF	82.60%	3'882'200.00	0.06	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	2'440	0	500	1'940 CHF	94.10%	1'825'540.00	0.03	a)
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	96.05%	1'824'950.00	0.03	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	2'800	0	500	2'300 CHF	98.40%	2'263'200.00	0.03	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	300	0	300 CHF	99.00%	297'000.00	0.00	a)
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	9'350	0	0	9'350 CHF	98.99%	9'255'565.00	0.13	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	10'890	0	0	10'890 CHF	97.76%	10'646'064.00	0.15	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'420	0	0	1'420 CHF	98.50%	1'398'700.00	0.02	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	98.10%	294'300.00	0.00	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	10'360	300	0	10'660 CHF	97.54%	10'397'764.00	0.15	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'250	0	0	2'250 CHF	98.55%	2'217'375.00	0.03	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	9'450	0	3'000	6'450 CHF	99.10%	6'391'950.00	0.09	a)
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	4'500	0	0	4'500 CHF	98.55%	4'434'750.00	0.06	a)
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'510	0	0	1'510 CHF	98.90%	1'493'390.00	0.02	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	6'300	0	0	6'300 CHF	98.41%	6'199'830.00	0.09	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	4'950	0	0	4'950 CHF	102.56%	5'076'720.00	0.07	a)
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	720	0	0	720 CHF	101.65%	731'880.00	0.01	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	97.65%	1'806'525.00	0.03	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	10'400	0	1'000	9'400 CHF	101.97%	9'585'180.00	0.14	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	33'670	8'200	0	41'870 CHF	95.60%	40'027'720.00	0.57	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	39'560	300	0	39'860 CHF	93.92%	37'436'512.00	0.53	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	27'000	0	1'500	25'500 CHF	114.85%	29'286'750.00	0.42	a)
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	800	0	0	800 CHF	97.95%	783'600.00	0.01	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	98.85%	790'800.00	0.01	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	7'950	0	0	7'950 CHF	98.23%	7'809'285.00	0.11	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.
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	9'840	300	0	10'140 CHF	98.80%	10'018'320.00	0.14	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	900	0	0	900 CHF	98.45%	886'050.00	0.01	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	3'530	0	0	3'530 CHF	98.05%	3'461'165.00	0.05	a)
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'800	0	0	1'800 CHF	98.55%	1'773'900.00	0.03	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	2'000	0	0	2'000 CHF	98.00%	1'960'000.00	0.03	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	1'000	0	0	1'000 CHF	100.35%	1'003'500.00	0.01	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	7'050	0	0	7'050 CHF	98.24%	6'925'920.00	0.10	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	1'120	0	0	1'120 CHF	100.70%	1'127'840.00	0.02	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	97.25%	1'264'250.00	0.02	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	3'700	0	0	3'700 CHF	97.40%	3'603'800.00	0.05	a)
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	2'800	0	0	2'800 CHF	97.40%	2'727'200.00	0.04	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	2'930	1'500	0	4'430 CHF	97.95%	4'339'185.00	0.06	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	2'900	0	0	2'900 CHF	98.97%	2'870'130.00	0.04	a)
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	300	0	0	300 CHF	98.40%	295'200.00	0.00	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	1'600	0	0	1'600 CHF	96.90%	1'550'400.00	0.02	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	7'000	980	0	7'980 CHF	96.55%	7'704'690.00	0.11	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	2'785	0	2'785	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	96.55%	2'606'850.00	0.04	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	2'800	0	300	2'500 CHF	95.30%	2'382'500.00	0.03	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	96.35%	1'830'650.00	0.03	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'900	300	0	2'200 CHF	91.60%	2'015'200.00	0.03	a)
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	4'000	0	2'500	1'500 CHF	94.00%	1'410'000.00	0.02	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	12'120	300	0	12'420 CHF	93.24%	11'580'408.00	0.16	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	500	1'000	0	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.02	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	1'000	0	0	1'000 CHF	92.35%	923'500.00	0.01	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	87.35%	2'271'100.00	0.03	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	6'450	0	0	6'450 CHF	89.10%	5'746'950.00	0.08	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'750	0	0	1'750 CHF	90.15%	1'577'625.00	0.02	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	5'430	0	0	5'430 CHF	93.15%	5'058'045.00	0.07	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	7'425	0	0	7'425 CHF	93.15%	6'916'387.50	0.10	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	7'260	0	0	7'260 CHF	93.11%	6'759'786.00	0.10	a)
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.50%	945'000.00	0.01	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	610	0	0	610 CHF	96.85%	590'785.00	0.01	a)
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	4'300	0	0	4'300 CHF	96.31%	4'141'330.00	0.06	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	3'700	0	1'000	2'700 CHF	98.86%	2'669'220.00	0.04	a)
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'720	0	500	1'220 CHF	96.00%	1'171'200.00	0.02	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	7'200	0	0	7'200 CHF	95.75%	6'894'000.00	0.10	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	7'360	300	0	7'660 CHF	97.20%	7'445'520.00	0.11	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	95.20%	1'237'600.00	0.02	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'440	0	0	1'440 CHF	95.75%	1'378'800.00	0.02	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	830	0	830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	8'900	0	0	8'900 CHF	95.90%	8'535'100.00	0.12	a)
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	98.57%	1'872'830.00	0.03	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0477380916	0.2500 % KBFRI 0 1/4 05/24/29	2'000	0	0	2'000 CHF	95.75%	1'915'000.00	0.03	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	4'510	0	0	4'510 CHF	93.90%	4'234'890.00	0.06	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'520	990	0	2'510 CHF	94.30%	2'366'930.00	0.03	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'500	500	0	3'000 CHF	96.90%	2'907'000.00	0.04	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	7'290	0	1'500	5'790 CHF	94.50%	5'471'550.00	0.08	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	3'780	2'340	0	6'120 CHF	90.85%	5'560'020.00	0.08	a)
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	1'030	0	0	1'030 CHF	94.25%	970'775.00	0.01	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	1'925	0	0	1'925 CHF	94.25%	1'814'312.50	0.03	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	2'800	1'000	0	3'800 CHF	95.80%	3'640'400.00	0.05	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	5'770	0	0	5'770 CHF	91.75%	5'293'975.00	0.08	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	7'550	0	0	7'550 CHF	97.11%	7'331'805.00	0.10	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	10'950	800	1'500	10'250 CHF	92.30%	9'460'750.00	0.13	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	5'910	0	0	5'910 CHF	90.10%	5'324'910.00	0.08	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.
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	1'0315	0	800	9'515 CHF	77.90%	7'412'185.00	0.11	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	1'370	0	0	1'370 CHF	94.20%	1'290'540.00	0.02	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	2'840	0	0	2'840 CHF	81.50%	2'314'600.00	0.03	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	440	0	0	440 CHF	97.35%	428'340.00	0.01	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	1'900	0	0	1'900 CHF	97.15%	1'845'850.00	0.03	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	1'540	0	0	1'540 CHF	92.10%	1'418'340.00	0.02	a)
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	2'690	0	0	2'690 CHF	98.70%	2'655'030.00	0.04	a)
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	1'650	0	0	1'650 CHF	93.45%	1'541'925.00	0.02	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	4'700	0	0	4'700 CHF	93.10%	4'375'700.00	0.06	a)
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	0	5'600	1'000	4'600 CHF	92.60%	4'259'600.00	0.06	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'850	0	0	2'850 CHF	98.85%	2'817'225.00	0.04	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	92.60%	1'944'600.00	0.03	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	3'350	0	0	3'350 CHF	75.20%	2'519'200.00	0.04	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	670	0	0	670 CHF	75.95%	508'865.00	0.01	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	3'850	0	1'500	2'350 CHF	97.75%	2'297'125.00	0.03	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	1'600	500	500	1'600 CHF	94.65%	1'514'400.00	0.02	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	0	300	0	300 CHF	97.55%	292'650.00	0.00	a)
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	1'320	0	0	1'320 CHF	82.00%	1'082'400.00	0.02	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	6'570	0	0	6'570 CHF	98.31%	6'458'967.00	0.09	a)
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	94.40%	1'510'400.00	0.02	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	98.40%	1'476'000.00	0.02	a)
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	3'060	0	0	3'060 CHF	96.90%	2'965'140.00	0.04	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	3'100	0	0	3'100 CHF	94.00%	2'914'000.00	0.04	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	3'330	0	0	3'330 CHF	90.85%	3'025'305.00	0.04	a)
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	4'740	0	0	4'740 CHF	93.95%	4'453'230.00	0.06	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	1'930	0	0	1'930 CHF	94.30%	1'819'990.00	0.03	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	5'100	0	1'000	4'100 CHF	95.65%	3'921'650.00	0.06	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	98.30%	786'400.00	0.01	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	7'900	0	0	7'900 CHF	93.35%	7'374'650.00	0.10	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	4'790	0	0	4'790 CHF	83.98%	4'022'642.00	0.06	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	1'990	0	200	1'790 CHF	95.40%	1'707'660.00	0.02	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	3'850	0	0	3'850 CHF	93.60%	3'603'600.00	0.05	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.85%	1'937'000.00	0.03	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	2'150	0	0	2'150 CHF	94.80%	2'038'200.00	0.03	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	2'600	0	0	2'600 CHF	94.10%	2'446'600.00	0.03	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.01	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	800	0	0	800 CHF	95.15%	761'200.00	0.01	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	5'990	0	0	5'990 CHF	91.65%	5'489'835.00	0.08	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	97.70%	1'367'800.00	0.02	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	3'010	0	0	3'010 CHF	92.60%	2'787'260.00	0.04	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	5'200	0	0	5'200 CHF	98.15%	5'103'800.00	0.07	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	2'460	0	0	2'460 CHF	90.15%	2'217'690.00	0.03	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	6'400	0	0	6'400 CHF	93.47%	5'982'080.00	0.08	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	1'620	945	0	2'565 CHF	90.60%	2'323'890.00	0.03	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	2'400	0	0	2'400 CHF	94.80%	2'275'200.00	0.03	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	4'600	0	0	4'600 CHF	97.31%	4'476'260.00	0.06	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	3'780	600	0	4'380 CHF	94.80%	4'152'240.00	0.06	a)
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	3'150	0	0	3'150 CHF	98.20%	3'093'300.00	0.04	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	4'120	0	0	4'120 CHF	98.86%	4'073'032.00	0.06	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	5'550	0	1'000	4'550 CHF	92.60%	4'213'300.00	0.06	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	1'600	0	500	1'100 CHF	90.80%	998'800.00	0.01	a)
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	2'950	0	0	2'950 CHF	90.55%	2'671'225.00	0.04	a)
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	5'700	0	0	5'700 CHF	94.90%	5'409'300.00	0.08	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBSNW 0 02/14/29	2'100	1'000	800	2'300 CHF	94.75%	2'179'250.00	0.03	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	5'350	0	0	5'350 CHF	90.30%	4'831'050.00	0.07	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	1'850	0	0	1'850 CHF	95.50%	1'766'750.00	0.03	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	4'100	0	0	4'100 CHF	91.20%	3'739'200.00	0.05	a)
CH0522158861	0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36	3'500	0	0	3'500 CHF	89.70%	3'139'500.00	0.04	a)
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	3'340	0	0	3'340 CHF	94.30%	3'149'620.00	0.04	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	1'100	0	0	1'100 CHF	93.30%	1'026'300.00	0.01	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.
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	770	0	0	770 CHF	93.35%	718'795.00	0.01	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	2'700	0	0	2'700 CHF	90.35%	2'439'450.00	0.03	a)
CH0522158960	0.3126 % KBFRIB 0.3126 02/02/32	3'000	0	800	2'200 CHF	93.55%	2'058'100.00	0.03	a)
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	4'900	300	0	5'200 CHF	94.40%	4'908'800.00	0.07	a)
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	2'350	500	0	2'850 CHF	95.40%	2'718'900.00	0.04	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	2'200	500	0	2'700 CHF	97.75%	2'639'250.00	0.04	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	2'300	0	0	2'300 CHF	107.70%	2'477'100.00	0.04	a)
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	2'700	1'300	0	4'000 CHF	109.60%	4'384'000.00	0.06	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	2'000	0	0	2'000 CHF	103.15%	2'063'000.00	0.03	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	2'500	750	0	3'250 CHF	101.80%	3'308'500.00	0.05	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	9'340	0	0	9'340 CHF	96.45%	9'008'430.00	0.13	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	4'950	300	0	5'250 CHF	80.15%	4'207'875.00	0.06	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	2'490	0	0	2'490 CHF	92.10%	2'293'290.00	0.03	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	7'400	0	0	7'400 CHF	94.46%	6'990'040.00	0.10	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	1'700	0	0	1'700 CHF	97.70%	1'660'900.00	0.02	a)
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	97.25%	3'112'000.00	0.04	a)
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	7'370	0	0	7'370 CHF	93.20%	6'868'840.00	0.10	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	3'480	0	0	3'480 CHF	85.37%	2'970'876.00	0.04	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	6'030	300	1'000	5'330 CHF	96.85%	5'162'105.00	0.07	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	4'570	0	0	4'570 CHF	86.05%	3'932'485.00	0.06	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	5'600	0	0	5'600 CHF	94.66%	5'300'960.00	0.08	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522	3'600	0	0	3'600 CHF	87.85%	3'162'600.00	0.04	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	7'050	0	0	7'050 CHF	90.68%	6'392'940.00	0.09	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	7'040	0	0	7'040 CHF	96.11%	6'766'144.00	0.10	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	6'835	0	0	6'835 CHF	89.77%	6'135'779.50	0.09	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893362	0.1500 % WKBNSW 0.15 10/05/32	4'200	0	500	3'700 CHF	91.35%	3'379'950.00	0.05	a)
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	7'395	0	0	7'395 CHF	94.00%	6'951'300.00	0.10	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	1'900	0	0	1'900 CHF	82.55%	1'568'450.00	0.02	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	2'570	0	1'300	1'270 CHF	93.45%	1'186'815.00	0.02	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	2'440	0	0	2'440 CHF	89.55%	2'185'020.00	0.03	a)
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	800	0	0	800 CHF	91.70%	733'600.00	0.01	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	6'000	0	0	6'000 CHF	97.33%	5'839'800.00	0.08	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	3'750	0	0	3'750 CHF	90.54%	3'395'250.00	0.05	a)
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'000	0	0	1'000 CHF	97.75%	977'500.00	0.01	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	10'100	0	0	10'100 CHF	96.65%	9'761'650.00	0.14	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'640	0	2'640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	5'730	1'000	0	6'730 CHF	99.95%	6'726'635.00	0.10	a)
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	1'390	0	0	1'390 CHF	91.65%	1'273'935.00	0.02	a)
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	2'450	0	2'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	4'150	0	4'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'670	0	0	1'670 CHF	96.00%	1'603'200.00	0.02	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	2'750	0	0	2'750 CHF	93.85%	2'580'875.00	0.04	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	2'430	0	0	2'430 CHF	95.85%	2'329'155.00	0.03	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	3'050	0	0	3'050 CHF	89.75%	2'737'375.00	0.04	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	2'640	0	2'640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	4'980	0	0	4'980 CHF	94.55%	4'708'590.00	0.07	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	1'730	0	1'730	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	5'200	0	0	5'200 CHF	96.45%	5'015'400.00	0.07	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	1'500	0	0	1'500 CHF	95.35%	1'430'250.00	0.02	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	1'000	0	0	1'000 CHF	91.50%	915'000.00	0.01	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	5'160	0	0	5'160 CHF	86.41%	4'458'756.00	0.06	a)
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	2'010	0	0	2'010 CHF	87.10%	1'750'710.00	0.02	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	3'900	1'000	1'000	3'900 CHF	97.75%	3'812'250.00	0.05	a)
CH0553331825	0.5000 % BALHOL 0 1/2 12/16/30	1'700	0	0	1'700 CHF	95.50%	1'623'500.00	0.02	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	1'180	0	0	1'180 CHF	81.15%	957'570.00	0.01	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'210	0	0	5'210 CHF	94.75%	4'936'475.00	0.07	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	5'800	0	0	5'800 CHF	87.10%	5'051'800.00	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.
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	6'300	0	0	6'300 CHF	99.35%	6'259'050.00	0.09	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	27'220	5'800	2'375	30'645 CHF	97.91%	30'004'519.50	0.43	a)
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	22'100	5'700	0	27'800 CHF	114.98%	31'964'440.00	0.45	a)
CH0557778948	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32 FEB	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778963	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33 MAR	0	3'900	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778989	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 APR	0	4'900	4'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778997	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 APR	0	4'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779003	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47	0	16'200	3'000	13'200 CHF	110.29%	14'558'280.00	0.21	a)
CH0557779011	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 10JU	0	3'900	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779029	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 19JU	0	4'400	4'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779037	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 5JL	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779045	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47 22JU	0	2'800	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	1'780	0	0	1'780 CHF	74.05%	1'318'090.00	0.02	a)
CH0564642046	0.1250 % PSYHO 0 1/8 08/17/40 692	4'250	0	0	4'250 CHF	84.85%	3'606'125.00	0.05	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	2'190	0	0	2'190 CHF	94.25%	2'064'075.00	0.03	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	5'550	0	0	5'550 CHF	94.80%	5'261'400.00	0.07	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	3'770	0	0	3'770 CHF	86.75%	3'270'475.00	0.05	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	3'800	0	0	3'800 CHF	93.05%	3'535'900.00	0.05	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	930	300	0	1'230 CHF	86.25%	1'060'875.00	0.02	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	99.10%	3'369'400.00	0.05	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	3'120	0	0	3'120 CHF	95.10%	2'967'120.00	0.04	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	2'780	0	0	2'780 CHF	92.20%	2'563'160.00	0.04	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	3'040	1'000	0	4'040 CHF	95.60%	3'862'240.00	0.05	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	98.71%	1'678'070.00	0.02	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	2'160	300	0	2'460 CHF	93.00%	2'287'800.00	0.03	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	3'680	0	750	2'930 CHF	98.10%	2'874'330.00	0.04	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'210	1'000	0	2'210 CHF	91.30%	2'017'730.00	0.03	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	13'600	0	0	13'600 CHF	94.35%	12'831'600.00	0.18	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	2'210	0	0	2'210 CHF	89.70%	1'982'370.00	0.03	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	3'000	750	0	3'750 CHF	96.65%	3'624'375.00	0.05	a)
CH0572142484	0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN	4'650	0	0	4'650 CHF	93.25%	4'336'125.00	0.06	a)
CH0572326988	0.0000 % PSYHO 0 08/12/25 693	5'700	300	3'500	2'500 CHF	98.91%	2'472'750.00	0.04	a)
CH0572327002	0.1250 % PSYHO 0 1/8 10/14/33 694	4'250	0	1'500	2'750 CHF	91.70%	2'521'750.00	0.04	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	6'350	0	2'950	3'400 CHF	99.43%	3'380'620.00	0.05	a)
CH0575017071	0.0000 % PSYHO 0 10/26/29 695	11'310	0	0	11'310 CHF	94.85%	10'727'535.00	0.15	a)
CH0575017089	0.1250 % PSYHO 0 1/8 11/19/32 696	9'410	0	0	9'410 CHF	92.43%	8'697'663.00	0.12	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	1'440	0	0	1'440 CHF	77.40%	1'114'560.00	0.02	a)
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	980	0	0	980 CHF	93.15%	912'870.00	0.01	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	2'530	0	0	2'530 CHF	66.30%	1'677'390.00	0.02	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	0	7'350	0	7'350 CHF	96.20%	7'070'700.00	0.10	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	2'350	0	0	2'350 CHF	97.30%	2'286'550.00	0.03	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	0	7'750	0	7'750 CHF	96.60%	7'486'500.00	0.11	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	6'480	0	0	6'480 CHF	90.65%	5'874'120.00	0.08	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	9'500	0	0	9'500 CHF	95.49%	9'071'550.00	0.13	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	9'100	0	0	9'100 CHF	91.06%	8'286'460.00	0.12	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	11'015	0	0	11'015 CHF	87.95%	9'687'692.50	0.14	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	8'200	0	0	8'200 CHF	93.41%	7'659'620.00	0.11	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	2'140	0	0	2'140 CHF	90.50%	1'936'700.00	0.03	a)
CH0591979619	0.0000 % PSYHO 0 05/20/41 697	5'900	0	0	5'900 CHF	82.80%	4'885'200.00	0.07	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	95.75%	1'149'000.00	0.02	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	1'700	0	500	1'200 CHF	97.10%	1'165'200.00	0.02	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	89.65%	1'703'350.00	0.02	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	3'000	0	0	3'000 CHF	90.75%	2'722'500.00	0.04	a)
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	5'500	0	0	5'500 CHF	93.15%	5'123'250.00	0.07	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	3'950	0	0	3'950 CHF	94.40%	3'728'800.00	0.05	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	5'100	0	0	5'100 CHF	96.70%	4'931'700.00	0.07	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'800	0	0	1'800 CHF	97.10%	1'747'800.00	0.02	a)
CH0593893958	0.1250 % PSYHO 0 1/8 03/03/33 698	2'370	0	0	2'370 CHF	92.14%	2'183'718.00	0.03	a)
CH0593893966	0.2500 % PSYHO 0 1/4 01/24/41 699	2'250	300	0	2'550 CHF	86.37%	2'202'435.00	0.03	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'940	0	0	2'940 CHF	82.95%	2'438'730.00	0.03	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.
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	1'840	0	0	1'840 CHF	85.40%	1'571'360.00	0.02	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	11'030	0	0	11'030 CHF	94.13%	10'382'539.00	0.15	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	2'200	0	0	2'200 CHF	91.50%	2'013'000.00	0.03	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.70%	1'894'000.00	0.03	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	2'600	0	0	2'600 CHF	98.35%	2'557'100.00	0.04	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	2'860	0	0	2'860 CHF	85.75%	2'452'450.00	0.03	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	3'680	0	0	3'680 CHF	93.75%	3'450'000.00	0.05	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	2'400	0	400	2'000 CHF	89.90%	1'798'000.00	0.03	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	19'600	300	0	19'900 CHF	96.43%	19'189'570.00	0.27	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	3'900	0	0	3'900 CHF	92.75%	3'617'250.00	0.05	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	4'600	0	0	4'600 CHF	90.48%	4'162'080.00	0.06	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	6'310	300	0	6'610 CHF	93.50%	6'180'350.00	0.09	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	3'200	0	0	3'200 CHF	93.30%	2'985'600.00	0.04	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	1'650	0	0	1'650 CHF	94.40%	1'557'600.00	0.02	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	5'210	0	0	5'210 CHF	93.70%	4'881'770.00	0.07	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	2'540	0	2'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	10'170	0	0	10'170 CHF	93.87%	9'546'579.00	0.14	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	3'980	0	0	3'980 CHF	90.61%	3'606'278.00	0.05	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	5'710	0	0	5'710 CHF	88.84%	5'072'764.00	0.07	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	4'760	0	1'000	3'760 CHF	93.00%	3'496'800.00	0.05	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31	3'800	0	0	3'800 CHF	92.90%	3'530'200.00	0.05	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	3'300	0	0	3'300 CHF	91.60%	3'022'800.00	0.04	a)
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	3'020	0	0	3'020 CHF	94.60%	2'856'920.00	0.04	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	4'900	0	0	4'900 CHF	94.55%	4'632'950.00	0.07	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	5'050	0	1'500	3'550 CHF	97.70%	3'468'350.00	0.05	a)
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	4'950	0	0	4'950 CHF	95.65%	4'734'675.00	0.07	a)
CH1112940601	0.0500 % NIDKKB 0.05 05/27/31	2'110	0	0	2'110 CHF	92.15%	1'944'365.00	0.03	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	5'290	0	0	5'290 CHF	92.05%	4'869'445.00	0.07	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	4'320	0	1'000	3'320 CHF	92.65%	3'075'980.00	0.04	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	3'550	0	0	3'550 CHF	97.70%	3'468'350.00	0.05	a)
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	93.30%	3'265'500.00	0.05	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	5'150	0	5'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	8'800	0	0	8'800 CHF	92.65%	8'153'200.00	0.12	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	2'550	0	0	2'550 CHF	87.90%	2'241'450.00	0.03	a)
CH1118483754	0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	93.20%	3'355'200.00	0.05	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	97.10%	1'262'300.00	0.02	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	92.60%	2'315'000.00	0.03	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	3'300	0	0	3'300 CHF	96.71%	3'191'430.00	0.05	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	2'890	0	0	2'890 CHF	86.85%	2'509'965.00	0.04	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	1'220	0	0	1'220 CHF	85.15%	1'038'830.00	0.01	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'000	0	0	2'000 CHF	85.30%	1'706'000.00	0.02	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33	2'900	0	0	2'900 CHF	90.15%	2'614'350.00	0.04	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	1'960	0	0	1'960 CHF	88.95%	1'743'420.00	0.02	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	4'125	1'000	0	5'125 CHF	94.10%	4'822'625.00	0.07	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	10'380	0	0	10'380 CHF	92.93%	9'646'134.00	0.14	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	3'400	0	0	3'400 CHF	87.19%	2'964'460.00	0.04	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	3'300	0	0	3'300 CHF	93.35%	3'080'550.00	0.04	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	93.50%	1'870'000.00	0.03	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	3'330	0	0	3'330 CHF	90.80%	3'023'640.00	0.04	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	2'350	0	0	2'350 CHF	96.40%	2'265'400.00	0.03	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	2'100	0	0	2'100 CHF	92.05%	1'933'050.00	0.03	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	5'370	0	0	5'370 CHF	93.71%	5'032'227.00	0.07	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	5'800	0	0	5'800 CHF	90.36%	5'240'880.00	0.07	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	3'800	0	1'000	2'800 CHF	89.90%	2'517'200.00	0.04	a)
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	1'460	0	0	1'460 CHF	95.35%	1'392'110.00	0.02	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	3'780	0	0	3'780 CHF	96.00%	3'628'800.00	0.05	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	95.10%	1'236'300.00	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.
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	500	0	0	500 CHF	92.85%	464'250.00	0.01	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	3'300	300	0	3'600 CHF	97.50%	3'510'000.00	0.05	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	4'600	0	0	4'600 CHF	84.60%	3'891'600.00	0.06	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	2'500	0	0	2'500 CHF	92.35%	2'308'750.00	0.03	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	2'350	0	500	1'850 CHF	94.65%	1'751'025.00	0.02	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	1'500	0	0	1'500 CHF	86.00%	1'290'000.00	0.02	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	96.80%	2'807'200.00	0.04	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	97.20%	3'499'200.00	0.05	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	3'350	0	0	3'350 CHF	94.06%	3'151'010.00	0.04	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	2'500	0	0	2'500 CHF	95.65%	2'391'250.00	0.03	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	0	200	0	200 CHF	96.30%	192'600.00	0.00	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	97.30%	2'335'200.00	0.03	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	3'925	0	0	3'925 CHF	96.28%	3'778'990.00	0.05	a)
CH1148266245	0.3000 % WKBNSW 0.3 02/07/30	300	0	0	300 CHF	95.05%	285'150.00	0.00	a)
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	2'200	0	0	2'200 CHF	94.75%	2'084'500.00	0.03	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	93.25%	2'238'000.00	0.03	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	94.15%	2'730'350.00	0.04	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	6'900	0	0	6'900 CHF	93.84%	6'474'960.00	0.09	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	4'650	0	0	4'650 CHF	94.60%	4'398'900.00	0.06	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'400	0	0	2'400 CHF	94.30%	2'263'200.00	0.03	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	2'100	0	0	2'100 CHF	94.46%	1'983'660.00	0.03	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	3'000	0	0	3'000 CHF	90.34%	2'710'200.00	0.04	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	2'600	0	500	2'100 CHF	98.05%	2'059'050.00	0.03	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	4'750	0	0	4'750 CHF	97.99%	4'654'525.00	0.07	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	3'900	0	0	3'900 CHF	97.23%	3'791'970.00	0.05	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	2'900	0	0	2'900 CHF	95.85%	2'779'650.00	0.04	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	2'100	0	0	2'100 CHF	92.75%	1'947'750.00	0.03	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	10'900	0	0	10'900 CHF	93.37%	10'177'330.00	0.14	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	2'200	0	0	2'200 CHF	96.10%	2'114'200.00	0.03	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	4'000	0	0	4'000 CHF	91.00%	3'640'000.00	0.05	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	4'150	0	0	4'150 CHF	97.25%	4'035'875.00	0.06	a)
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	400	0	0	400 CHF	98.30%	393'200.00	0.01	a)
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	300	700	0	1'000 CHF	95.50%	955'000.00	0.01	a)
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	1'300	0	0	1'300 CHF	96.20%	1'250'600.00	0.02	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	2'000	0	0	2'000 CHF	98.14%	1'962'800.00	0.03	a)
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	1'800	0	0	1'800 CHF	97.05%	1'746'900.00	0.02	a)
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	1'300	0	0	1'300 CHF	96.70%	1'257'100.00	0.02	a)
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	2'100	0	1'000	1'100 CHF	97.20%	1'069'200.00	0.02	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	14'400	300	1'000	13'700 CHF	98.65%	13'515'050.00	0.19	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	13'100	1'300	1'000	13'400 CHF	97.70%	13'091'800.00	0.19	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	6'300	0	1'000	5'300 CHF	98.25%	5'207'250.00	0.07	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	1'600	0	0	1'600 CHF	98.00%	1'568'000.00	0.02	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	1'500	0	0	1'500 CHF	96.20%	1'443'000.00	0.02	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'380	0	0	1'380 CHF	98.05%	1'353'090.00	0.02	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	98.45%	1'772'100.00	0.03	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	1'550	0	0	1'550 CHF	91.80%	1'422'900.00	0.02	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	3'800	700	0	4'500 CHF	97.90%	4'405'500.00	0.06	a)
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	2'000	0	0	2'000 CHF	96.80%	1'936'000.00	0.03	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	3'900	0	0	3'900 CHF	98.30%	3'833'700.00	0.05	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	3'350	0	0	3'350 CHF	98.48%	3'299'080.00	0.05	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	1'800	0	0	1'800 CHF	98.36%	1'770'480.00	0.03	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	1'800	0	500	1'300 CHF	100.70%	1'309'100.00	0.02	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	1'660	0	0	1'660 CHF	105.80%	1'756'280.00	0.02	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	4'800	0	0	4'800 CHF	100.27%	4'812'960.00	0.07	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	7'400	0	0	7'400 CHF	102.60%	7'592'400.00	0.11	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	6'100	0	0	6'100 CHF	106.00%	6'466'000.00	0.09	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	98.10%	1'079'100.00	0.02	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	98.50%	2'167'000.00	0.03	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.
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	98.20%	2'749'600.00	0.04	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	5'500	0	0	5'500 CHF	99.83%	5'490'650.00	0.08	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	1'700	0	0	1'700 CHF	102.76%	1'746'920.00	0.02	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	98.25%	1'670'250.00	0.02	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	98.70%	1'085'700.00	0.02	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	0	5'450	0	5'450 CHF	100.60%	5'482'700.00	0.08	a)
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	3'000	0	0	3'000 CHF	99.10%	2'973'000.00	0.04	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	950	0	0	950 CHF	98.45%	935'275.00	0.01	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	99.10%	2'279'300.00	0.03	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	99.60%	3'585'600.00	0.05	a)
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	99.50%	2'388'000.00	0.03	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	3'900	0	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	2'400	600	0	3'000 CHF	100.90%	3'027'000.00	0.04	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	2'400	600	750	2'250 CHF	102.10%	2'297'250.00	0.03	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	11'650	1'000	0	12'650 CHF	102.34%	12'946'010.00	0.18	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	7'500	0	0	7'500 CHF	106.55%	7'991'250.00	0.11	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'450	0	0	2'450 CHF	99.60%	2'440'200.00	0.03	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	0	4'110	0	4'110 CHF	101.30%	4'163'430.00	0.06	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	2'150	0	0	2'150 CHF	99.00%	2'128'500.00	0.03	a)
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	2'500	500	500	2'500 CHF	100.45%	2'511'250.00	0.04	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	3'400	0	400	3'000 CHF	101.05%	3'031'500.00	0.04	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	9'200	0	0	9'200 CHF	102.51%	9'430'920.00	0.13	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	11'400	300	0	11'700 CHF	104.89%	12'272'130.00	0.17	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	7'300	0	0	7'300 CHF	113.38%	8'276'740.00	0.12	a)
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	3'200	0	0	3'200 CHF	126.75%	4'056'000.00	0.06	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	4'300	0	0	4'300 CHF	102.33%	4'400'190.00	0.06	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	10'840	300	0	11'140 CHF	104.75%	11'669'150.00	0.17	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	6'150	0	0	6'150 CHF	107.65%	6'620'475.00	0.09	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	3'100	0	0	3'100 CHF	101.55%	3'148'050.00	0.04	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	7'100	6'400	0	13'500 CHF	103.80%	14'013'000.00	0.20	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	3'400	0	0	3'400 CHF	115.00%	3'910'000.00	0.06	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	99.90%	2'747'250.00	0.04	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	100.35%	1'705'950.00	0.02	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	2'000	1'000	0	3'000 CHF	102.95%	3'088'500.00	0.04	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	3'500	0	0	3'500 CHF	101.80%	3'563'000.00	0.05	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'680	500	0	2'180 CHF	101.55%	2'213'790.00	0.03	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	3'250	0	0	3'250 CHF	107.55%	3'495'375.00	0.05	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	0	4'450	1'600	2'850 CHF	103.65%	2'954'025.00	0.04	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	100.27%	3'108'370.00	0.04	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	4'700	0	0	4'700 CHF	108.35%	5'092'450.00	0.07	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	9'500	1'000	0	10'500 CHF	115.32%	12'108'600.00	0.17	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	6'750	350	1'500	5'600 CHF	130.59%	7'313'040.00	0.10	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	101.15%	2'326'450.00	0.03	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	100.45%	2'913'050.00	0.04	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	1'080	0	0	1'080 CHF	110.55%	1'193'940.00	0.02	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	101.85%	2'342'550.00	0.03	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	850	0	0	850 CHF	123.70%	1'051'450.00	0.01	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	2'950	0	0	2'950 CHF	102.55%	3'025'225.00	0.04	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'800	0	0	1'800 CHF	99.71%	1'794'780.00	0.03	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	102.25%	2'658'500.00	0.04	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	1'100	0	0	1'100 CHF	109.45%	1'203'950.00	0.02	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	4'400	0	2'300	2'100 CHF	99.67%	2'093'070.00	0.03	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	5'100	0	0	5'100 CHF	109.72%	5'595'720.00	0.08	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	1'500	0	0	1'500 CHF	100.30%	1'504'500.00	0.02	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	2'300	0	0	2'300 CHF	102.25%	2'351'750.00	0.03	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	99.65%	2'391'600.00	0.03	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	102.05%	306'150.00	0.00	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.
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'610	0	0	2'610 CHF	99.68%	2'601'648.00	0.04	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	100.90%	2'118'900.00	0.03	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	3'700	6'700	0	10'400 CHF	102.36%	10'645'440.00	0.15	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	5'800	0	0	5'800 CHF	107.26%	6'221'080.00	0.09	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	1'750	0	0	1'750 CHF	100.40%	1'757'000.00	0.02	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	2'500	0	500	2'000 CHF	99.70%	1'994'000.00	0.03	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	2'650	0	0	2'650 CHF	99.95%	2'648'675.00	0.04	a)
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	3'300	0	0	3'300 CHF	104.45%	3'446'850.00	0.05	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	4'400	0	1'200	3'200 CHF	102.24%	3'271'680.00	0.05	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	7'100	0	0	7'100 CHF	108.56%	7'707'760.00	0.11	a)
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	3'700	0	0	3'700 CHF	106.17%	3'928'290.00	0.06	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	4'200	0	0	4'200 CHF	110.63%	4'646'460.00	0.07	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	2'600	0	1'000	1'600 CHF	101.10%	1'617'600.00	0.02	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	3'600	0	0	3'600 CHF	100.93%	3'633'480.00	0.05	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	5'100	0	0	5'100 CHF	106.40%	5'426'400.00	0.08	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	6'530	500	0	7'030 CHF	115.24%	8'101'372.00	0.12	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	6'680	0	0	6'680 CHF	101.90%	6'806'920.00	0.10	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	1'615	0	0	1'615 CHF	120.75%	1'950'112.50	0.03	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	3'300	0	0	3'300 CHF	102.30%	3'375'900.00	0.05	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	5'550	300	500	5'350 CHF	104.70%	5'601'450.00	0.08	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	5'300	0	0	5'300 CHF	103.45%	5'482'850.00	0.08	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	4'800	0	0	4'800 CHF	100.60%	4'828'800.00	0.07	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	102.25%	3'476'500.00	0.05	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	1'150	0	0	1'150 CHF	101.30%	1'164'950.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	1'200	0	0	1'200 CHF	105.20%	1'262'400.00	0.02	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	1'100	0	0	1'100 CHF	103.00%	1'133'000.00	0.02	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	101.30%	1'316'900.00	0.02	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	1'300	0	0	1'300 CHF	107.35%	1'395'550.00	0.02	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	10'000	0	1'500	8'500 CHF	100.95%	8'580'750.00	0.12	a)
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	7'500	0	2'700	4'800 CHF	106.80%	5'126'400.00	0.07	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	104.60%	2'615'000.00	0.04	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	4'300	0	0	4'300 CHF	110.55%	4'753'650.00	0.07	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	2'800	0	0	2'800 CHF	100.95%	2'826'600.00	0.04	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'300	0	0	2'300 CHF	103.55%	2'381'650.00	0.03	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	10'100	300	0	10'400 CHF	108.71%	11'305'840.00	0.16	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	102.80%	1'130'800.00	0.02	a)
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	2'100	0	0	2'100 CHF	119.95%	2'518'950.00	0.04	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'700	0	0	1'700 CHF	101.06%	1'718'020.00	0.02	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	1'800	500	0	2'300 CHF	103.95%	2'390'850.00	0.03	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	900	0	0	900 CHF	102.10%	918'900.00	0.01	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	2'500	0	0	2'500 CHF	126.95%	3'173'750.00	0.05	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	1'500	0	0	1'500 CHF	103.80%	1'557'000.00	0.02	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	1'500	0	0	1'500 CHF	107.60%	1'614'000.00	0.02	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	8'200	0	0	8'200 CHF	108.12%	8'865'840.00	0.13	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	8'700	0	0	8'700 CHF	114.00%	9'918'000.00	0.14	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	107.65%	1'184'150.00	0.02	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'100	800	0	3'900 CHF	102.75%	4'007'250.00	0.06	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	960	0	0	960 CHF	145.50%	1'396'800.00	0.02	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	1'890	0	500	1'390 CHF	112.75%	1'567'225.00	0.02	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.60%	207'200.00	0.00	a)
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	3'800	500	0	4'300 CHF	104.00%	4'472'000.00	0.06	a)
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	1'100	0	0	1'100 CHF	104.60%	1'150'600.00	0.02	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'800	0	0	2'800 CHF	100.45%	2'812'600.00	0.04	a)
CH1230442613	1.8750 % BCG 1 7/8 12/09/30	1'400	0	0	1'400 CHF	103.65%	1'451'100.00	0.02	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	1'500	1'000	0	2'500 CHF	101.15%	2'528'750.00	0.04	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	4'100	0	0	4'100 CHF	107.10%	4'391'100.00	0.06	a)
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	1'600	600	0	2'200 CHF	104.90%	2'307'800.00	0.03	a)
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	1'200	0	0	1'200 CHF	106.55%	1'278'600.00	0.02	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	3'200	1'000	0	4'200 CHF	105.15%	4'416'300.00	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.
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	3'800	300	0	4'100 CHF	111.05%	4'553'050.00	0.06	a)
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	103.20%	1'444'800.00	0.02	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	102.35%	1'330'550.00	0.02	a)
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	2'200	0	0	2'200 CHF	99.65%	2'192'300.00	0.03	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	1'060	0	0	1'060 CHF	101.26%	1'073'356.00	0.02	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	5'300	3'600	0	8'900 CHF	104.07%	9'262'230.00	0.13	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	6'700	0	0	6'700 CHF	106.82%	7'156'940.00	0.10	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	1'100	0	0	1'100 CHF	109.35%	1'202'850.00	0.02	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBSNW 2.05 07/24/28	2'250	0	0	2'250 CHF	103.60%	2'331'000.00	0.03	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	2'400	0	0	2'400 CHF	108.45%	2'602'800.00	0.04	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	1'600	0	0	1'600 CHF	102.55%	1'640'800.00	0.02	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	3'600	0	0	3'600 CHF	106.20%	3'823'200.00	0.05	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	1'100	0	0	1'100 CHF	104.40%	1'148'400.00	0.02	a)
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	104.30%	1'564'500.00	0.02	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	101.80%	2'341'400.00	0.03	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	4'300	0	0	4'300 CHF	100.90%	4'338'700.00	0.06	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	2'950	0	0	2'950 CHF	104.95%	3'096'025.00	0.04	a)
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	3'200	0	0	3'200 CHF	110.06%	3'521'920.00	0.05	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	1'600	0	0	1'600 CHF	123.60%	1'977'600.00	0.03	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'750	0	0	1'750 CHF	100.10%	1'751'750.00	0.02	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	6'530	0	0	6'530 CHF	113.03%	7'380'859.00	0.10	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	2'600	0	0	2'600 CHF	118.15%	3'071'900.00	0.04	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	3'100	0	0	3'100 CHF	136.95%	4'245'450.00	0.06	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	3'950	0	3'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	300	0	300 CHF	103.70%	311'100.00	0.00	a)
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	4'400	0	0	4'400 CHF	105.08%	4'623'520.00	0.07	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	5'900	0	0	5'900 CHF	107.46%	6'340'140.00	0.09	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	4'310	0	0	4'310 CHF	110.06%	4'743'586.00	0.07	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	1'800	0	0	1'800 CHF	103.30%	1'859'400.00	0.03	a)
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	2'715	0	0	2'715 CHF	104.50%	2'837'175.00	0.04	a)
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	103.65%	2'176'650.00	0.03	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	4'700	3'700	0	8'400 CHF	103.34%	8'680'560.00	0.12	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	7'000	0	0	7'000 CHF	106.51%	7'455'700.00	0.11	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'800	0	0	1'800 CHF	103.60%	1'864'800.00	0.03	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	3'700	0	0	3'700 CHF	100.52%	3'719'240.00	0.05	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	4'200	0	0	4'200 CHF	102.30%	4'296'600.00	0.06	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	100.90%	1'715'300.00	0.02	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	0	300	0	300 CHF	103.85%	311'550.00	0.00	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	104.65%	3'034'850.00	0.04	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	5'800	0	2'500	3'300 CHF	108.80%	3'590'400.00	0.05	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	5'100	2'500	0	7'600 CHF	105.30%	8'002'800.00	0.11	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	2'100	0	0	2'100 CHF	100.85%	2'117'850.00	0.03	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	1'200	0	0	1'200 CHF	102.30%	1'227'600.00	0.02	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	3'750	0	1'300	2'450 CHF	103.84%	2'544'080.00	0.04	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	2'100	500	0	2'600 CHF	102.55%	2'666'300.00	0.04	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	2'100	0	0	2'100 CHF	102.40%	2'150'400.00	0.03	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	104.35%	1'147'850.00	0.02	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	103.80%	1'453'200.00	0.02	a)
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	3'800	0	0	3'800 CHF	107.40%	4'081'200.00	0.06	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	3'100	0	0	3'100 CHF	102.06%	3'163'860.00	0.04	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	6'200	0	0	6'200 CHF	106.67%	6'613'540.00	0.09	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	6'500	1'300	0	7'800 CHF	110.71%	8'635'380.00	0.12	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	4'500	800	0	5'300 CHF	103.10%	5'464'300.00	0.08	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	4'750	0	4'750 CHF	104.30%	4'954'250.00	0.07	a)
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	0	4'100	0	4'100 CHF	109.65%	4'495'650.00	0.06	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	2'055	0	2'055	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	103.60%	3'729'600.00	0.05	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	7'000	0	0	7'000 CHF	107.64%	7'534'800.00	0.11	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	7'195	500	0	7'695 CHF	111.35%	8'568'382.50	0.12	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.
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	104.90%	2'832'300.00	0.04	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	2'000	0	0	2'000 CHF	101.15%	2'023'000.00	0.03	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	103.15%	2'269'300.00	0.03	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	2'300	0	0	2'300 CHF	105.65%	2'429'950.00	0.03	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	103.15%	2'681'900.00	0.04	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	2'660	0	1'000	1'660 CHF	108.30%	1'797'780.00	0.03	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	300	0	300 CHF	103.35%	310'050.00	0.00	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	4'300	0	0	4'300 CHF	103.55%	4'452'650.00	0.06	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.60%	5'080'000.00	0.07	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	3'300	0	0	3'300 CHF	105.45%	3'479'850.00	0.05	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	4'200	0	0	4'200 CHF	106.30%	4'464'600.00	0.06	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	4'900	400	0	5'300 CHF	108.35%	5'742'550.00	0.08	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	4'100	1'000	0	5'100 CHF	104.75%	5'342'250.00	0.08	a)
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	2'100	0	0	2'100 CHF	100.50%	2'110'500.00	0.03	a)
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	2'500	0	0	2'500 CHF	103.05%	2'576'250.00	0.04	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	2'500	0	0	2'500 CHF	101.30%	2'532'500.00	0.04	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	1'600	0	1'600 CHF	115.40%	1'846'400.00	0.03	a)
CH1265890801	1.6000 % KBBS 1.6 06/24/31 004	0	3'700	0	3'700 CHF	103.25%	3'820'250.00	0.05	a)
CH1265890827	1.6000 % KBBS 1.6 06/28/44 005	0	1'665	0	1'665 CHF	108.80%	1'811'520.00	0.03	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	1'110	0	0	1'110 CHF	154.85%	1'718'835.00	0.02	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	3'130	0	0	3'130 CHF	102.63%	3'212'319.00	0.05	a)
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	5'300	0	0	5'300 CHF	105.25%	5'578'250.00	0.08	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	5'500	0	0	5'500 CHF	109.85%	6'041'750.00	0.09	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	1'400	0	0	1'400 CHF	101.25%	1'417'500.00	0.02	a)
CH1266847255	1.8000 % WKBSW 1.8 08/29/29	2'800	300	0	3'100 CHF	103.80%	3'217'800.00	0.05	a)
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	6'500	0	0	6'500 CHF	103.85%	6'750'250.00	0.10	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	9'600	0	0	9'600 CHF	106.70%	10'243'200.00	0.15	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	6'400	0	0	6'400 CHF	110.20%	7'052'800.00	0.10	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	3'685	0	0	3'685 CHF	106.35%	3'918'997.50	0.06	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	102.90%	3'498'600.00	0.05	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	3'600	0	0	3'600 CHF	101.70%	3'661'200.00	0.05	a)
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	2'700	0	0	2'700 CHF	104.80%	2'829'600.00	0.04	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	1'300	0	0	1'300 CHF	102.30%	1'329'900.00	0.02	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	2'100	0	0	2'100 CHF	103.05%	2'164'050.00	0.03	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	1'480	600	0	2'080 CHF	102.75%	2'137'200.00	0.03	a)
CH1271007952	2.3750 % HYN0E 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	2'300	0	2'300 CHF	103.00%	2'369'000.00	0.03	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	3'700	400	0	4'100 CHF	105.20%	4'313'200.00	0.06	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	1'750	0	0	1'750 CHF	107.25%	1'876'875.00	0.03	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	1'500	800	0	2'300 CHF	102.60%	2'359'800.00	0.03	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	103.85%	3'011'650.00	0.04	a)
CH1271360575	1.7500 % AIIB 1 3/4 06/26/30	2'100	0	0	2'100 CHF	104.35%	2'191'350.00	0.03	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	104.65%	2'302'300.00	0.03	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	2'800	0	0	2'800 CHF	105.40%	2'951'200.00	0.04	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	103.20%	1'960'800.00	0.03	a)
CH1271360617	1.2125 % EBRD 1.2125 03/04/31 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	101.95%	2'548'750.00	0.04	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	2'620	0	2'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	104.95%	4'198'000.00	0.06	a)
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	1'000	0	0	1'000 CHF	101.30%	1'013'000.00	0.01	a)
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	1'700	0	0	1'700 CHF	104.15%	1'770'550.00	0.03	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	0	6'100	1'000	5'100 CHF	108.00%	5'508'000.00	0.08	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	7'300	300	0	7'600 CHF	113.15%	8'599'400.00	0.12	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	3'200	3'600	0	6'800 CHF	119.57%	8'130'760.00	0.12	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	1'700	0	0	1'700 CHF	101.70%	1'728'900.00	0.02	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	5'900	3'300	0	9'200 CHF	105.85%	9'738'200.00	0.14	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	5'900	0	0	5'900 CHF	108.11%	6'378'490.00	0.09	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	4'390	500	0	4'890 CHF	106.00%	5'183'400.00	0.07	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	1'280	0	0	1'280 CHF	102.95%	1'317'760.00	0.02	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	106.25%	2'975'000.00	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.
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	103.95%	2'494'800.00	0.04	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	107.05%	2'033'950.00	0.03	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	3'400	0	0	3'400 CHF	103.25%	3'510'500.00	0.05	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	1'200	0	0	1'200 CHF	109.30%	1'311'600.00	0.02	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	104.25%	1'980'750.00	0.03	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	102.00%	2'958'000.00	0.04	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	3'255	0	0	3'255 CHF	114.35%	3'722'092.50	0.05	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	2'600	0	750	1'850 CHF	106.10%	1'962'850.00	0.03	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	10'300	800	3'000	8'100 CHF	112.17%	9'085'770.00	0.13	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	4'500	0	0	4'500 CHF	106.02%	4'770'900.00	0.07	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	3'100	4'600	0	7'700 CHF	115.65%	8'905'050.00	0.13	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	2'000	0	0	2'000 CHF	105.20%	2'104'000.00	0.03	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	3'600	0	0	3'600 CHF	105.65%	3'803'400.00	0.05	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	5'100	1'000	0	6'100 CHF	102.25%	6'237'250.00	0.09	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	105.90%	1'270'800.00	0.02	a)
CH1289657095	1.8750 % VORHYP 1 7/8 09/13/30 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	104.50%	2'299'000.00	0.03	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	1'700	0	0	1'700 CHF	138.05%	2'346'850.00	0.03	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	0	3'900	0	3'900 CHF	103.60%	4'040'400.00	0.06	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	4'300	300	0	4'600 CHF	113.35%	5'214'100.00	0.07	a)
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	5'300	0	0	5'300 CHF	106.18%	5'627'540.00	0.08	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	2'400	0	0	2'400 CHF	109.55%	2'629'200.00	0.04	a)
CH1290222509	1.7000 % TESSIN 1.7 10/31/33	3'900	300	0	4'200 CHF	107.00%	4'494'000.00	0.06	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	1'900	0	0	1'900 CHF	112.50%	2'137'500.00	0.03	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	2'100	0	0	2'100 CHF	102.35%	2'149'350.00	0.03	a)
CH1290222541	2.4000 % AMALEA 2.4 11/22/30	1'700	0	0	1'700 CHF	105.60%	1'795'200.00	0.03	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	3'900	0	0	3'900 CHF	101.80%	3'970'200.00	0.06	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	104.30%	2'503'200.00	0.04	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	100.75%	1'914'250.00	0.03	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	905	905	0	1'810 CHF	103.30%	1'869'730.00	0.03	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	102.85%	2'674'100.00	0.04	a)
CH1290871032	1.3475 % TPNZ 1.3475 03/21/31 EMTN	0	1'845	0	1'845 CHF	101.85%	1'879'132.50	0.03	a)
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	103.80%	3'633'000.00	0.05	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRIB 1.9 09/08/26	1'400	0	0	1'400 CHF	101.45%	1'420'300.00	0.02	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	103.30%	1'962'700.00	0.03	a)
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	0	1'350	0	1'350 CHF	100.80%	1'360'800.00	0.02	a)
CH1291601941	1.5200 % ACANXB 1.52 03/25/33	0	1'710	0	1'710 CHF	101.95%	1'743'345.00	0.02	a)
CH1291601958	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44 MAY	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291601966	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28 MAY	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	1'700	0	0	1'700 CHF	102.95%	1'750'150.00	0.02	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.85%	3'055'500.00	0.04	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	104.55%	1'777'350.00	0.03	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	3'500	0	0	3'500 CHF	103.90%	3'636'500.00	0.05	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	103.75%	1'971'250.00	0.03	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	1'700	0	0	1'700 CHF	101.55%	1'726'350.00	0.02	a)
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	1'600	0	0	1'600 CHF	104.60%	1'673'600.00	0.02	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	5'400	0	0	5'400 CHF	101.35%	5'472'900.00	0.08	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	6'800	300	750	6'350 CHF	106.95%	6'791'325.00	0.10	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	2'700	0	0	2'700 CHF	103.50%	2'794'500.00	0.04	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	4'200	0	0	4'200 CHF	111.45%	4'680'900.00	0.07	a)
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	104.75%	1'676'000.00	0.02	a)
CH1305916749	1.5600 % AUCCCN 1.56 11/30/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.95%	2'059'000.00	0.03	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	4'200	0	0	4'200 CHF	102.50%	4'305'000.00	0.06	a)
CH1305916772	1.7500 % ROSW 1 3/4 09/15/33	4'900	680	1'000	4'580 CHF	105.75%	4'843'350.00	0.07	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	4'700	0	1'500	3'200 CHF	109.75%	3'512'000.00	0.05	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	5'200	0	0	5'200 CHF	108.95%	5'665'400.00	0.08	a)
CH1305916889	2.2150 % GLENLN 2.215 01/18/30 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	102.90%	1'646'400.00	0.02	a)
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.55%	1'523'250.00	0.02	a)
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	3'200	0	300	2'900 CHF	104.90%	3'042'100.00	0.04	a)
CH1306117073	1.4500 % ZURICH 1.45 12/01/34	960	0	0	960 CHF	106.15%	1'019'040.00	0.01	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.
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	3'500	5'000	0	8'500 CHF	101.19%	8'601'150.00	0.12	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	2'600	3'600	0	6'200 CHF	102.48%	6'353'760.00	0.09	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	2'000	0	0	2'000 CHF	104.40%	2'088'000.00	0.03	a)
CH1306117149	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/34	1'275	0	0	1'275 CHF	103.80%	1'323'450.00	0.02	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	720	0	0	720 CHF	108.05%	777'960.00	0.01	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	1'500	0	0	1'500 CHF	113.75%	1'706'250.00	0.02	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	5'200	2'500	0	7'700 CHF	105.15%	8'096'550.00	0.11	a)
CH1310346247	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 12/21/38 749	4'600	0	1'600	3'000 CHF	106.75%	3'202'500.00	0.05	a)
CH1310346262	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 05/28/30 751	0	4'900	0	4'900 CHF	101.42%	4'969'580.00	0.07	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	6'400	6'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	3'800	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346296	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 MAR	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346304	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 03/25/33	0	3'600	0	3'600 CHF	103.10%	3'711'600.00	0.05	a)
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	2'510	0	2'510 CHF	108.35%	2'719'585.00	0.04	a)
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	0	1'800	0	1'800 CHF	103.60%	1'864'800.00	0.03	a)
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	101.90%	815'200.00	0.01	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	2'700	0	0	2'700 CHF	101.40%	2'737'800.00	0.04	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	2'000	0	0	2'000 CHF	103.30%	2'066'000.00	0.03	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	4'650	0	4'650 CHF	101.95%	4'740'675.00	0.07	a)
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	8'300	0	8'300 CHF	104.00%	8'632'000.00	0.12	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	0	300	0	300 CHF	103.70%	311'100.00	0.00	a)
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	2'500	2'800	0	5'300 CHF	102.95%	5'456'350.00	0.08	a)
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	6'500	0	0	6'500 CHF	104.09%	6'765'850.00	0.10	a)
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	2'420	0	0	2'420 CHF	105.83%	2'561'086.00	0.04	a)
CH1319968447	1.2000 % ZURICH 1.2 03/07/30	3'800	0	0	3'800 CHF	102.25%	3'885'500.00	0.06	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	2'100	0	0	2'100 CHF	105.35%	2'212'350.00	0.03	a)
CH1319968462	1.4150 % LUGANO 1.415 03/07/34	0	1'300	0	1'300 CHF	103.45%	1'344'850.00	0.02	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	5'100	0	5'100 CHF	102.05%	5'204'550.00	0.07	a)
CH1319968512	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 MAR	0	3'700	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	6'400	0	6'400 CHF	103.05%	6'595'200.00	0.09	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	0	3'360	0	3'360 CHF	104.45%	3'509'520.00	0.05	a)
CH1319968579	2.1000 % ALLNSW 2.1 04/04/31	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	3'600	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968611	1.4000 % PFZENT 1.4 11/06/34 590	0	8'500	0	8'500 CHF	102.96%	8'751'600.00	0.12	a)
CH1319968629	1.4000 % PFZENT 1.4 03/15/38 591	0	5'400	0	5'400 CHF	103.81%	5'605'740.00	0.08	a)
CH1319968645	1.5000 % KBSH 1 1/2 04/25/36	0	3'100	500	2'600 CHF	103.95%	2'702'700.00	0.04	a)
CH1319968678	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 MAY	0	2'800	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968686	1.4500 % PFZENT 1.45 12/07/33 592	0	5'700	0	5'700 CHF	103.41%	5'894'370.00	0.08	a)
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	0	3'700	0	3'700 CHF	104.56%	3'868'720.00	0.05	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	101.75%	3'663'000.00	0.05	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	2'000	0	0	2'000 CHF	100.85%	2'017'000.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	3'400	0	0	3'400 CHF	103.90%	3'532'600.00	0.05	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	2'270	0	0	2'270 CHF	103.10%	2'340'370.00	0.03	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	2'000	0	0	2'000 CHF	102.80%	2'056'000.00	0.03	a)
CH1321508330	1.5000 % CDCEPS 1 1/2 05/24/39 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	104.05%	1'456'700.00	0.02	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	0	4'780	0	4'780 CHF	102.00%	4'875'600.00	0.07	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	0	5'510	0	5'510 CHF	105.15%	5'793'765.00	0.08	a)
CH1323274063	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 FEB	0	3'700	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274071	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 FEB	0	6'700	6'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	9'000	0	9'000 CHF	107.20%	9'648'000.00	0.14	a)
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	0	1'700	0	1'700 CHF	101.25%	1'721'250.00	0.02	a)
CH1325037039	1.5000 % BQTESS 1 1/2 05/03/34	0	4'000	0	4'000 CHF	102.40%	4'096'000.00	0.06	a)
CH1325037054	1.3000 % NEUNBG 1.3 06/12/48	0	2'200	0	2'200 CHF	108.20%	2'380'400.00	0.03	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/11/28 EMTN	0	4'200	0	4'200 CHF	101.75%	4'273'500.00	0.06	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	570	0	570 CHF	126.40%	720'480.00	0.01	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	0	2'300	0	2'300 CHF	100.75%	2'317'250.00	0.03	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	3'200	0	3'200 CHF	100.75%	3'224'000.00	0.05	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	101.90%	2'445'600.00	0.03	a)
CH1331113626	1.3150 % SCDA 1.315 05/02/34	0	1'300	0	1'300 CHF	102.85%	1'337'050.00	0.02	a)
CH1331440235	1.4500 % KBSCHW 1.45 03/14/31	0	1'800	0	1'800 CHF	101.95%	1'835'100.00	0.03	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.
CH1335850256	1.5125 % RATPPF 1.5125 03/06/36 APR	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850264	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 APR	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	101.85%	1'222'200.00	0.02	a)
CH1335850280	1.1525 % NIB 1.1525 05/02/31 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	102.10%	1'123'100.00	0.02	a)
CH1335850298	1.4778 % AFLBNK 1.4778 04/20/34 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	102.65%	1'642'400.00	0.02	a)
CH1335850314	0.9475 % IADB 0.9475 07/26/32	0	2'000	0	2'000 CHF	101.16%	2'023'120.00	0.03	a)
CH1337248970	1.2000 % BERN 1.2 04/22/39	0	3'100	0	3'100 CHF	104.25%	3'231'750.00	0.05	a)
CH1337248996	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 MAY	0	3'900	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249002	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 MAY	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249010	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 MAY	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249028	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 MAY	0	4'600	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249044	1.1500 % KTBL 1.15 06/24/33	0	1'800	0	1'800 CHF	102.85%	1'851'300.00	0.03	a)
CH1340267090	1.3500 % KBAARG 1.35 04/30/31	0	2'050	0	2'050 CHF	101.20%	2'074'600.00	0.03	a)
CH1341034952	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 APR	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034960	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/20/34 752	0	3'200	0	3'200 CHF	103.90%	3'324'800.00	0.05	a)
CH1341034978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/19/39 753	0	3'700	0	3'700 CHF	105.57%	3'906'090.00	0.06	a)
CH1341034986	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/24/54 754	0	3'800	500	3'300 CHF	111.20%	3'669'600.00	0.05	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.45%	5'222'500.00	0.07	a)
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	105	105	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	0	7'100	0	7'100 CHF	101.85%	7'231'350.00	0.10	a)
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	0	3'100	0	3'100 CHF	103.50%	3'208'500.00	0.05	a)
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28	0	4'400	0	4'400 CHF	101.30%	4'457'200.00	0.06	a)
CH1344316703	1.9150 % SLOVAK 1.915 05/10/34	0	4'000	0	4'000 CHF	103.90%	4'156'000.00	0.06	a)
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	1'900	0	1'900 CHF	102.05%	1'938'950.00	0.03	a)
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	1'600	1'000	600 CHF	104.05%	624'300.00	0.01	a)
CH1346742864	1.5000 % BQNCHT 1 1/2 05/23/34	0	2'200	0	2'200 CHF	102.90%	2'263'800.00	0.03	a)
CH1346742914	2.4000 % SGKNSW 2.4 05/30/34	0	2'665	0	2'665 CHF	105.30%	2'806'245.00	0.04	a)
CH1346742971	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 JUN	0	3'600	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742989	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 594	0	6'400	0	6'400 CHF	103.31%	6'611'840.00	0.09	a)
CH1346742997	1.4500 % PFZENT 1.45 10/10/39 595	0	3'300	0	3'300 CHF	104.58%	3'451'140.00	0.05	a)
CH1346743003	1.3750 % EGW 1 3/8 06/21/44 71	0	2'200	0	2'200 CHF	109.45%	2'407'900.00	0.03	a)
CH1346743037	1.2530 % RHBSZS 1.253 06/18/40	0	1'800	0	1'800 CHF	105.75%	1'903'500.00	0.03	a)
CH1346743052	1.3000 % ZURICH 1.3 06/24/37	0	4'400	0	4'400 CHF	105.60%	4'646'400.00	0.07	a)
CH1346743094	1.6000 % BQTESS 1.6 07/10/36	0	2'600	0	2'600 CHF	103.50%	2'691'000.00	0.04	a)
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	0	1'170	1'000	170 CHF	101.50%	172'550.00	0.00	a)
CH1348614053	2.0500 % BARY 2.05 05/17/30	0	5'600	0	5'600 CHF	103.00%	5'768'000.00	0.08	a)
CH1348614061	2.4000 % BARY 2.4 05/17/34	0	4'800	0	4'800 CHF	105.00%	5'040'000.00	0.07	a)
CH1348614145	1.7500 % BALHOL 1 3/4 06/07/34	0	1'900	0	1'900 CHF	103.30%	1'962'700.00	0.03	a)
CH1348614178	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 06/04/35	0	1'700	0	1'700 CHF	103.55%	1'760'350.00	0.02	a)
CH1348614186	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40 JUN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614194	1.3000 % ZURCTY 1.3 06/04/49	0	2'200	0	2'200 CHF	109.30%	2'404'600.00	0.03	a)
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	2'500	0	2'500 CHF	101.45%	2'536'250.00	0.04	a)
CH1348968657	1.6000 % GRKPSW 1.6 06/26/34	0	2'300	500	1'800 CHF	103.80%	1'868'400.00	0.03	a)
CH1349191804	1.6000 % BCG 1.6 06/10/30	0	2'200	0	2'200 CHF	101.85%	2'240'700.00	0.03	a)
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	1'800	0	1'800 CHF	100.61%	1'811'052.00	0.03	a)
CH1349643085	1.7000 % BCVAUD 1.7 06/04/38	0	1'600	0	1'600 CHF	105.30%	1'684'800.00	0.02	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMNVX 1.8 08/23/34	0	300	0	300 CHF	105.75%	317'250.00	0.00	a)
CH1350727801	2.0000 % SCMNVX 2 11/23/39	0	300	0	300 CHF	108.25%	324'750.00	0.00	a)
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	0	4'000	0	4'000 CHF	100.97%	4'038'800.00	0.06	a)
CH1353015014	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 JUL	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015022	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 07/24/37 757	0	3'500	0	3'500 CHF	103.01%	3'605'350.00	0.05	a)
CH1353015030	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/24/47 758	0	3'200	0	3'200 CHF	104.23%	3'335'360.00	0.05	a)
CH1353257749	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	105.05%	2'521'200.00	0.04	a)
CH1353257863	1.9500 % HELNSW 1.95 06/26/34	0	4'100	0	4'100 CHF	105.45%	4'323'450.00	0.06	a)
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	6'700	0	6'700 CHF	101.46%	6'797'820.00	0.10	a)
CH1353257889	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 JUN	0	4'100	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257897	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 JUN	0	3'600	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353258168	1.1575 % IBRD 1.1575 06/11/31 EMTN	0	3'360	0	3'360 CHF	102.25%	3'435'600.00	0.05	a)
CH1356524871	1.4295 % LAUSAN 1.4295 06/28/46	0	1'300	0	1'300 CHF	109.05%	1'417'650.00	0.02	a)
CH1357852735	1.4900 % HANWHA 1.49 08/06/27	0	1'745	0	1'745 CHF	100.49%	1'753'498.15	0.02	a)
CH1360255025	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41 JUN	0	1'600	1'600	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.
CH1361401701	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 JUL	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401719	1.2500 % PFZENT 1 1/4 04/19/33 596	0	3'000	0	3'000 CHF	101.44%	3'043'200.00	0.04	a)
CH1361401727	1.3000 % PFZENT 1.3 11/14/39 597	0	1'600	0	1'600 CHF	102.46%	1'639'360.00	0.02	a)
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	0	1'440	0	1'440 CHF	101.25%	1'458'000.00	0.02	a)
CH1361401743	1.4000 % IWBBAS 1.4 07/13/34	0	1'760	0	1'760 CHF	102.60%	1'805'760.00	0.03	a)
CH1361401784	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 AUG	0	2'500	0	2'500 CHF	104.15%	2'603'650.00	0.04	a)
CH1361401792	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 AUG	0	5'700	0	5'700 CHF	103.43%	5'895'282.00	0.08	a)
CH1361401800	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 AUG	0	1'900	0	1'900 CHF	113.72%	2'160'661.00	0.03	a)
<b>CHF</b>							<b>5'525'848'445.45</b>	<b>78.46</b>	

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

							<b>1'459'814'017.98</b>	<b>20.73</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>1'459'814'017.98</b>	<b>20.73</b>	
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	13'799'342	2'133'450	1'054'539	14'878'253 CHF	98.12	1'459'814'017.98	20.73	a)
<b>CHF</b>							<b>1'459'814'017.98</b>	<b>20.73</b>	

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	17'259'520.69	0.25
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	5'525'848'445.45	78.46
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'459'814'017.98	20.73
Sonstige Vermögenswerte	39'994'925.96	0.57
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>7'042'916'910.08</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-187'033.00	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>7'042'729'877.08</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	6'985'662'463.43	99.19
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	
ASTT CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-
BVG 3 Index 45	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-
DT CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-
FA CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-

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
ASTT CHF	0.140	1.000	0.090	0.050	-
DT CHF	0.140	0.400	0.090	0.050	-
FA CHF	0.180	0.500	0.080	0.100	-
GT CHF	0.110	0.350	0.060	0.050	-
NT CHF	-	-	-	-	-

**Periode:** 01.02.2024 - 30.04.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.720	6.000	0.590	0.130	-

**Periode:** 01.05.2024 - 31.05.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.710	6.000	0.580	0.130	-

**Periode:** 01.06.2024 - 30.06.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.730	6.000	0.600	0.130	-

**Periode:** 01.07.2024 - 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
BVG 3 Index 45	0.720	6.000	0.590	0.130	-

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 Index

## 9 TER

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

## 10 Fussnoten

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

## 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.