

## Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

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

**Halbjahresbericht per 31. Juli 2017**

---

<b>Inhaltsverzeichnis</b>	<b>Seite</b>
Organisation und Verwaltung .....	2
Vertriebsorganisation.....	3
Abschlusszahlen.....	4
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I.....	29
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung .....	29
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte .....	29
Pauschale Verwaltungskommission .....	30
Benchmark.....	30
TER.....	30
Erklärung der Fussnoten .....	30
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte .....	31

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

**Swisscanto Fondsleitung AG**

Zürich, 18.09.2017

## Organisation und Verwaltung

---

### Fondsleitung

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

### Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Prasident  
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,  
Services & Directbanking, Zurcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied  
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement  
Anlage- & Vorsorgegeschaft, Zurcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Mitglied  
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,  
Zurcher Kantonalbank

### Geschaftsleitung

Hans Frey  
Geschaftsfuhrer

Andreas Hogg  
stellvertretender Geschaftsfuhrer und Leiter Risk, Finance & Services

Markus Erb (bis 31.05.2017)  
Leiter Legal, Compliance & Investment Controlling

Silvia Karrer  
Leiterin Administration & Operations

### Delegation der Anlageentscheide

Zurcher Kantonalbank, Zurich

### Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

### Depotbank

Zurcher Kantonalbank, Zurich

### Prufgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zurich

## Vertriebsorganisation

---

**Zahlstelle:** Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

**Vertriebstrager:** Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

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

Übersicht	Rechnungsperiode bis	01.02.2017	01.02.2016	08.07.2015
		31.07.2017	31.01.2017	31.01.2016
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'049'588'906.11	2'058'512'199.51	1'734'734'101.48
<b>Klasse FA CHF</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'269'408.16	3'244'509.63	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		34'034.767	33'401.004	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.0608	97.1381	
Ausschüttung je Anteil		-	0.60	
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'046'319'497.95	2'055'267'689.88	1'734'734'101.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		20'542'071.175	20'436'912.835	17'134'027.542
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.6160	100.5664	101.2450
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		87.5704	94.3211	91.3167
Thesaurierung je Anteil		-	1.56	2.20
Total Expense Ratio (TER)		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	YTD / 31.07.2017	2016	2015	2014
Klasse FA CHF (Lancierung 13.07.2016)	-0.71 %	-2.65 %	-	-
Klasse NT CHF (Lancierung 08.07.2015)	-0.61 %	1.35 %	0.20 %	-
Benchmark	-0.62 %	1.32 %	0.13 %	-
Tracking Error *	-	0.07 %	-	-

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

\* Tracking Error: Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
 Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) \* QUADRATWURZEL(12)

**Vermögensrechnung**

(Verkehrswerte)	31.07.2017	31.01.2017
Bankguthaben auf Sicht	9'521'581.12	7'538'732.99
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'023'482'076.70	2'031'931'640.00
Sonstige Vermögenswerte	16'585'754.38	19'042'326.92
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'049'589'412.20</b>	<b>2'058'512'699.91</b>
Andere Verbindlichkeiten	-506.09	-500.40
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'049'588'906.11</b>	<b>2'058'512'199.51</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile Klasse FA CHF	Rechnungsperiode	01.02.2017	Lancierung 13.07.2016
	bis	31.07.2017	31.01.2017
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		33'401.004	0.000
Ausgegebene Anteile		3'449.763	33'402.004
Zuruckgenommene Anteile		-2'816.000	-1.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>34'034.767</b>	<b>33'401.004</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile Klasse NT CHF	Rechnungsperiode	01.02.2017	01.02.2016
	bis	31.07.2017	31.01.2017
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		20'436'912.835	17'134'027.542
Ausgegebene Anteile		499'419.265	1'700'630.684
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		761'689.547	1'794'785.072
Zuruckgenommene Anteile		-670'145.472	-192'530.463
Zuruckgenommene Anteile (Sachauslagen)		-485'805.000	0.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>20'542'071.175</b>	<b>20'436'912.835</b>

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	15.03.2017	12'215'381.82	121'517.915
Klasse NT CHF	28.06.2017	64'204'349.39	640'171.632
Sachauslagen (Rucknahme von Anteilen)	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	23.02.2017	49'236'822.56	485'805.000

Veranderung des Nettofondsvermogens (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.02.2017	01.02.2016
	bis	31.07.2017	31.01.2017
Nettofondsvermogen zu Beginn der Rechnungsperiode		2'058'512'199.51	1'734'734'101.48
Ausbezahlte Ausschuttung		-20'358.95	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-10'802'624.01	-2'465'848.65
Saldo aus dem Anteilverkehr		9'211'747.55	338'576'917.06
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-7'312'057.99	-12'332'970.38
<b>Nettofondsvermogen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'049'588'906.11</b>	<b>2'058'512'199.51</b>

Erfolgsrechnung (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.02.2017	01.02.2016
	bis	31.07.2017	31.01.2017
<b>Ertrag</b>			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-3'098.25	-1'660.65
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		13'844'423.64	29'341'248.19
Sonstige Erträge		0.00	19'240.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		503'220.05	2'662'233.42
<b>Total Ertrag</b>		<b>14'344'545.44</b>	<b>32'021'060.96</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütung		-2'925.00	-1'661.74
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-139'164.29	-171'945.74
<b>Total Aufwand</b>		<b>-142'089.29</b>	<b>-173'607.48</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>14'202'456.15</b>	<b>31'847'453.48</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-4'827'401.41	-5'899'928.03
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		235'969.27	1'240'334.04
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>9'611'024.01</b>	<b>27'187'859.49</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-16'923'082.00	-39'520'829.87
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-7'312'057.99</b>	<b>-12'332'970.38</b>

**Inventar des Fondsvermogens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveranderungen wahrend der Periode**

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Kaufe / Zugange 2)	Verkaufe / Abgange 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wah- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.02.2017			31.07.2017					
<b>Wertpapiere, die an einer Borse kotiert sind</b>								<b>2'023'482'076.70</b>	<b>98.73</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>								<b>2'023'482'076.70</b>	<b>98.73</b>	
CH0008435569	4.0000 % SWISS 4 02/11/23	19'205	3'094	3'000	19'299	CHF	124.41%	24'009'885.90	1.18	a)
CH0008673201	3.7500 % STGALN 3 3/4 04/09/18	400	0	400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	23'675	1'937	0	25'612	CHF	141.90%	36'343'428.00	1.78	a)
CH0008805449	0.0000 % IBRD 0 11/26/21	3'000	0	200	2'800	CHF	101.70%	2'847'600.00	0.14	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	8'770	800	0	9'570	CHF	204.00%	19'522'800.00	0.96	a)
CH0013843443	2.8750 % RESFER 2 7/8 02/26/21 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	111.30%	1'669'500.00	0.08	a)
CH0015221663	3.0000 % SWISS 3 01/08/18	1'677	0	1'677	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	15'308	500	0	15'808	CHF	150.00%	23'712'000.00	1.17	a)
CH0017410314	3.2500 % EUROF 3 1/4 12/28/18	1'095	0	100	995	CHF	105.35%	1'048'232.50	0.05	a)
CH0017640209	3.1250 % STGALN 3 1/8 02/03/20	180	0	0	180	CHF	108.95%	196'110.00	0.01	a)
CH0017992477	3.0000 % SEK 3 02/27/18 EMTN	2'180	0	2'180	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0018454253	3.0000 % SWISS 3 05/12/19	22'349	1'500	600	23'249	CHF	106.77%	24'822'957.30	1.22	a)
CH0018712346	3.3750 % EUROF 3 3/8 12/29/20	500	250	100	650	CHF	112.60%	731'900.00	0.04	a)
CH0019903365	3.1250 % GE 3 1/8 12/06/19	1'500	0	100	1'400	CHF	108.35%	1'516'900.00	0.07	a)
CH0020372402	2.7500 % OKB 2 3/4 01/28/20	940	0	100	840	CHF	108.30%	909'720.00	0.04	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	100	0	0	100	CHF	128.75%	128'750.00	0.01	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	1'500	0	0	1'500	CHF	119.60%	1'794'000.00	0.09	a)
CH0020616196	2.7500 % KFW 2 3/4 10/11/18 1	700	700	100	1'300	CHF	104.20%	1'354'600.00	0.07	a)
CH0020625528	2.5000 % PBBGR 2 1/2 03/09/17 EMTN	820	0	820	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020626773	2.7500 % SNCF 2 3/4 01/23/19 EMTN	950	0	100	850	CHF	104.70%	889'950.00	0.04	a)
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	5'280	0	0	5'280	CHF	131.25%	6'930'000.00	0.34	a)
CH0020669583	2.3750 % KA 2 3/8 03/15/17 EMTN	2'450	0	2'450	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	3'250	0	1'000	2'250	CHF	121.30%	2'729'250.00	0.13	a)
CH0020827561	2.5000 % RENTEN 2 1/2 03/05/18 EMTN	900	0	0	900	CHF	101.94%	917'460.00	0.04	a)
CH0020899941	2.7500 % KWOBER 2 3/4 04/04/17	1'300	0	1'300	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0021247967	2.7500 % EGW 2 3/4 04/30/20 24	1'000	0	100	900	CHF	108.80%	979'200.00	0.05	a)
CH0021803942	2.3750 % EIB 2 3/8 07/10/20	6'270	0	100	6'170	CHF	108.75%	6'709'875.00	0.33	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	5'020	0	2'000	3'020	CHF	119.10%	3'596'820.00	0.18	a)
CH0021908907	2.2500 % SWISS 2 1/4 07/06/20	20'540	1'500	765	21'275	CHF	108.68%	23'121'670.00	1.14	a)
CH0022061508	2.3750 % EUROF 2 3/8 08/03/20	2'995	0	100	2'895	CHF	108.30%	3'135'285.00	0.15	a)
CH0022235607	2.3750 % NEDWBK 2 3/8 08/19/20 EMTN	1'750	0	100	1'650	CHF	108.70%	1'793'550.00	0.09	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	3'800	0	0	3'800	CHF	120.45%	4'577'100.00	0.22	a)
CH0022271362	2.3750 % CFF 2 3/8 08/24/18 EMTN	4'220	0	100	4'120	CHF	103.16%	4'250'192.00	0.21	a)
CH0022280058	2.3750 % KA 2 3/8 08/26/20 EMTN	330	0	100	230	CHF	106.75%	245'525.00	0.01	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'120	0	0	2'120	CHF	118.40%	2'510'080.00	0.12	a)
CH0022653221	2.2500 % EGW 2 1/4 09/19/17 25	260	0	260	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0022721762	2.2500 % BNG 2 1/4 10/14/20 EMTN	3'690	0	100	3'590	CHF	108.75%	3'904'125.00	0.19	a)
CH0022788647	2.1250 % OKB 2 1/8 10/18/18	450	700	0	1'150	CHF	103.35%	1'188'525.00	0.06	a)
CH0022843228	2.2500 % ELEM 2 1/4 10/26/17	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0022862988	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/19/18 395	3'640	0	100	3'540	CHF	103.35%	3'658'590.00	0.18	a)
CH0023194373	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 11/15/17 396	4'355	0	4'355	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0023266841	2.6250 % KBLUZE 2 5/8 11/25/20	780	0	100	680	CHF	109.45%	744'260.00	0.04	a)
CH0023438010	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 12/13/19 397	4'355	1'000	200	5'155	CHF	106.98%	5'514'819.00	0.27	a)
CH0023710160	2.3750 % EGW 2 3/8 01/12/18 27	1'370	0	1'370	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0023960328	2.3750 % NEDWBK 2 3/8 01/27/23 EMTN	1'620	0	0	1'620	CHF	114.10%	1'848'420.00	0.09	a)
CH0023972752	2.5000 % GE 2 1/2 02/08/18	1'505	0	1'505	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0023991182	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/27/21 399	5'440	0	100	5'340	CHF	109.36%	5'839'824.00	0.28	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	2'080	0	0	2'080	CHF	125.15%	2'603'120.00	0.13	a)
CH0024151414	2.2500 % NRW 2 1/4 03/01/19 EMTN	500	0	0	500	CHF	104.55%	522'750.00	0.03	a)
CH0024318724	2.5000 % DHY 2 1/2 03/08/18 EMTN	150	0	0	150	CHF	101.88%	152'820.00	0.01	a)
CH0024402718	2.3750 % AMSTEG 2 3/8 03/09/18	500	0	0	500	CHF	101.60%	508'000.00	0.02	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	2'260	0	0	2'260	CHF	132.45%	2'993'370.00	0.15	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	800	0	0	800	CHF	119.65%	957'200.00	0.05	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	14'192	1'000	0	15'192	CHF	139.14%	21'138'148.80	1.04	a)
CH0024674944	2.5000 % KBBS 2 1/2 03/24/21	1'670	0	100	1'570	CHF	109.80%	1'723'860.00	0.08	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	4'400	800	0	5'200	CHF	124.10%	6'453'200.00	0.31	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0025633717	3.3750 % GE 3 3/8 06/19/18	1'980	0	1'980	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0025739316	3.1250 % TOTAL 3 1/8 06/28/18	2'845	0	2'845	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	300	0	0	300	CHF	136.80%	410'400.00	0.02	a)	
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	147.85%	2'661'300.00	0.13	a)	
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	960	0	0	960	CHF	120.75%	1'159'200.00	0.06	a)	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	320	200	0	520	CHF	147.90%	769'080.00	0.04	a)	
CH0026302304	3.3750 % ABNAV 3 3/8 08/15/31 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	141.40%	2'969'400.00	0.14	a)	
CH0026424041	3.1250 % PSHYPO 3 1/8 08/15/18 406	2'400	0	100	2'300	CHF	103.93%	2'390'390.00	0.12	a)	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	2'540	0	0	2'540	CHF	123.65%	3'140'710.00	0.15	a)	
CH0026791225	3.1250 % C 3 1/8 09/27/21 EMTN	1'860	0	100	1'760	CHF	112.90%	1'987'040.00	0.10	a)	
CH0026950078	2.7500 % UKRAIL 2 3/4 10/06/21 EMTN	1'100	0	100	1'000	CHF	113.05%	1'130'500.00	0.06	a)	
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMT	1'810	0	0	1'810	CHF	133.80%	2'421'780.00	0.12	a)	
CH0027015038	2.7500 % PFZENT 2 3/4 10/02/18 371	1'800	0	100	1'700	CHF	103.99%	1'767'830.00	0.09	a)	
CH0027188611	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 10/16/20 409	2'560	1'000	100	3'460	CHF	109.91%	3'802'886.00	0.19	a)	
CH0027333241	2.6250 % RATPPF 2 5/8 11/06/19 EMTN	1'470	0	100	1'370	CHF	106.65%	1'461'105.00	0.07	a)	
CH0027539151	3.1250 % MS 3 1/8 11/21/18 EMTN	1'680	0	100	1'580	CHF	104.40%	1'649'520.00	0.08	a)	
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	2'980	0	0	2'980	CHF	119.05%	3'547'690.00	0.17	a)	
CH0027815288	2.6250 % SNCF 2 5/8 12/13/21 EMTN	2'410	0	200	2'210	CHF	111.45%	2'463'045.00	0.12	a)	
CH0027972139	2.5000 % SGKNSW 2 1/2 12/12/18	1'280	0	0	1'280	CHF	104.08%	1'332'224.00	0.06	a)	
CH0027982179	2.5000 % NEDWBK 2 1/2 12/27/18 EMTN	2'490	0	100	2'390	CHF	104.43%	2'495'877.00	0.12	a)	
CH0028608195	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 02/07/22 EMTN	4'070	0	1'000	3'070	CHF	113.30%	3'478'310.00	0.17	a)	
CH0028608856	2.5000 % EIB 2 1/2 02/08/19 EMTN	3'645	0	100	3'545	CHF	104.85%	3'716'932.50	0.18	a)	
CH0028644646	2.6250 % NESNVX 2 5/8 02/14/18 EMTM	570	0	570	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0028945605	3.1250 % LHNVX 3 1/8 02/20/17	540	0	540	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0028968201	2.8750 % PSHYPO 2 7/8 02/14/22 415	2'230	0	0	2'230	CHF	113.86%	2'539'078.00	0.12	a)	
CH0029298426	2.7500 % PFZENT 2 3/4 02/28/17 374	1'860	0	1'860	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0029365100	3.0000 % C 3 03/21/19 EMTN	500	0	100	400	CHF	105.40%	421'600.00	0.02	a)	
CH0029450126	2.8750 % PSHYPO 2 7/8 03/15/19 416	2'650	0	200	2'450	CHF	105.56%	2'586'220.00	0.13	a)	
CH0029630131	2.7500 % HSBC 2 3/4 04/03/17 EMTN	200	0	200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0030356718	3.0000 % BKWSW 3 04/27/22	500	0	0	500	CHF	113.25%	566'250.00	0.03	a)	
CH0030644030	3.2500 % POLAND 3 1/4 05/15/19 EMTN	3'840	0	100	3'740	CHF	106.50%	3'983'100.00	0.19	a)	
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	3'810	0	0	3'810	CHF	120.05%	4'573'905.00	0.22	a)	
CH0030876111	3.0000 % CFF 3 06/07/22 EMTN	1'290	0	0	1'290	CHF	115.35%	1'488'015.00	0.07	a)	
CH0030985599	3.0000 % HSHN 3 06/14/19 EMTN	500	0	100	400	CHF	105.90%	423'600.00	0.02	a)	
CH0031084087	3.0000 % ZURCTY 3 06/08/22	1'100	0	0	1'100	CHF	115.25%	1'267'750.00	0.06	a)	
CH0031102061	3.0000 % OKB 3 06/14/22	2'130	0	0	2'130	CHF	115.90%	2'468'670.00	0.12	a)	
CH0031212100	3.0000 % BQTESS 3 06/15/17	280	0	280	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	700	0	0	700	CHF	128.41%	898'870.00	0.04	a)	
CH0031280875	3.1250 % BYLAN 3 1/8 06/27/18 EMTN	200	0	100	100	CHF	103.47%	103'470.00	0.01	a)	
CH0031388124	3.1250 % BNG 3 1/8 07/02/18 EMTN	3'880	0	100	3'780	CHF	103.52%	3'913'056.00	0.19	a)	
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	150	700	0	850	CHF	118.85%	1'010'225.00	0.05	a)	
CH0031442731	3.2500 % KBBS 3 1/4 06/29/22	2'300	0	0	2'300	CHF	116.25%	2'673'750.00	0.13	a)	
CH0031823823	3.1250 % BERN 3 1/8 06/27/19	3'710	0	900	2'810	CHF	106.90%	3'003'890.00	0.15	a)	
CH0031835439	3.2500 % BUNIMM 3 1/4 07/16/19 EMTN	1'320	500	100	1'720	CHF	107.35%	1'846'420.00	0.09	a)	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	9'050	750	0	9'800	CHF	131.87%	12'923'260.00	0.63	a)	
CH0031901066	3.5000 % SGKNSW 3 1/2 07/27/17	3'980	0	3'980	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0032254739	3.7500 % SCMN 3 3/4 07/19/17 B	510	0	510	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0032637719	2.5000 % NIB 2 1/2 04/11/18 EMTN	700	0	0	700	CHF	102.25%	715'750.00	0.03	a)	
CH0032897628	3.3750 % KFW 3 3/8 08/30/17	1'360	0	1'360	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0033023216	3.5000 % CAFFIL 3 1/2 08/28/19	870	0	100	770	CHF	108.40%	834'680.00	0.04	a)	
CH0033037679	3.5000 % RABOBK 3 1/2 08/31/23 EMTN	1'900	0	0	1'900	CHF	120.15%	2'282'850.00	0.11	a)	
CH0033470748	3.2500 % PFZENT 3 1/4 09/10/19 382	1'800	0	100	1'700	CHF	107.86%	1'833'620.00	0.09	a)	
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	2'720	400	1'000	2'120	CHF	132.45%	2'807'940.00	0.14	a)	
CH0033961746	3.3750 % PSHYPO 3 3/8 10/10/22 427	2'710	0	0	2'710	CHF	118.07%	3'199'697.00	0.16	a)	
CH0034493137	3.2500 % CDCEPS 3 1/4 11/13/17 EMTN	200	0	200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0035031340	3.2500 % IDF 3 1/4 11/27/18 EMTN	2'270	0	100	2'170	CHF	105.01%	2'278'717.00	0.11	a)	
CH0035613691	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 12/12/18 430	3'550	0	200	3'350	CHF	105.23%	3'525'205.00	0.17	a)	
CH0035678728	3.0000 % KBBL 3 12/14/17 1	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0036702964	3.2500 % KTBS 3 1/4 01/31/20	1'100	0	100	1'000	CHF	109.25%	1'092'500.00	0.05	a)	
CH0037204515	3.0000 % PFZENT 3 02/15/18 386	1'380	0	0	1'380	CHF	101.97%	1'407'186.00	0.07	a)	
CH0037972392	4.8750 % CS 4 7/8 03/14/18 EMTN	2'205	0	2'205	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		



ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe /	Verkufe /	Anzahl /		Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.
		Nominal in	Tsd.			Nominal in	Tsd.					
		01.02.2017		2)	3)	31.07.2017						
CH0039139263	4.5000 % ROSW 4 1/2 03/23/17	2'040	0	2'040	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0039139404	2.8750 % ZURCTY 2 7/8 04/21/21	1'815	0	100	1715	1715	CHF	111.65%	1'914'797.50	0.09	a)	
CH0039165268	3.2500 % EIB 3 1/4 04/30/18 EMTN	2'805	0	0	2'805	2'805	CHF	102.99%	2'888'869.50	0.14	a)	
CH0039193450	3.2500 % KOMMUN 3 1/4 05/08/18 EMT	1'200	0	100	1'100	1'100	CHF	103.07%	1'133'770.00	0.06	a)	
CH0039266512	3.3750 % COE 3 3/8 11/06/20 EMTN	960	0	100	860	860	CHF	112.75%	969'650.00	0.05	a)	
CH0039480675	3.2500 % HESSEN 3 1/4 05/22/17	600	0	600	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0042899630	3.5000 % PFZENT 3 1/2 06/21/18 388	1'560	0	100	1'460	1'460	CHF	103.71%	1'514'166.00	0.07	a)	
CH0043140794	3.6250 % CDCEPS 3 5/8 04/16/18 EMTN	900	0	900	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0043595203	3.7500 % ONT 3 3/4 07/30/18 EMTN	2'350	0	0	2'350	2'350	CHF	104.43%	2'454'105.00	0.12	a)	
CH0043918413	3.5000 % ZURCTY 3 1/2 08/14/20	1'365	0	100	1'265	1'265	CHF	111.65%	1'412'372.50	0.07	a)	
CH0044004684	3.5000 % KBAARG 3 1/2 08/14/17	1'020	0	1'020	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0045259980	3.1250 % PFZENT 3 1/8 09/15/17 390	500	0	500	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0045490817	4.5000 % GE 4 1/2 10/09/18 EMTN	2'760	0	0	2'760	2'760	CHF	105.97%	2'924'772.00	0.14	a)	
CH0046229917	3.8750 % ALPHSW 3 7/8 10/30/18	1'010	0	0	1'010	1'010	CHF	104.23%	1'052'723.00	0.05	a)	
CH0046254477	3.2500 % VDP 3 1/4 11/05/18 EMTN	820	0	0	820	820	CHF	104.79%	859'278.00	0.04	a)	
CH0048758525	2.8750 % BRCOL 2 7/8 12/27/17 EMTN	450	0	450	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0049484618	3.8750 % Q 3 7/8 12/11/18 EMTN	2'150	0	0	2'150	2'150	CHF	106.09%	2'280'935.00	0.11	a)	
CH0049836759	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/20/19	500	0	100	400	400	CHF	104.95%	419'800.00	0.02	a)	
CH0049874594	2.6250 % PFZENT 2 5/8 02/08/19 394	1'250	0	100	1'150	1'150	CHF	104.87%	1'206'005.00	0.06	a)	
CH0100128385	2.7500 % IBRD 2 3/4 05/07/19 EMTN	900	0	100	800	800	CHF	106.10%	848'800.00	0.04	a)	
CH0100345682	2.8750 % BRCOL 2 7/8 11/27/18 EMTN	780	400	100	1'080	1'080	CHF	104.68%	1'130'544.00	0.06	a)	
CH0100484697	2.6250 % BIENNE 2 5/8 04/12/19	150	0	0	150	150	CHF	105.05%	157'575.00	0.01	a)	
CH0100524187	2.6250 % BERN 2 5/8 04/24/20	1'395	0	100	1'295	1'295	CHF	108.30%	1'402'485.00	0.07	a)	
CH0100525382	3.0000 % CADES 3 04/21/21 EMTN	1'000	0	100	900	900	CHF	112.30%	1'010'700.00	0.05	a)	
CH0100683017	2.7500 % IADB 2 3/4 04/15/19 EMTN	1'550	0	100	1'450	1'450	CHF	105.85%	1'534'825.00	0.07	a)	
CH0101032537	3.3750 % ONT 3 3/8 04/29/19 EMTN	500	0	0	500	500	CHF	106.90%	534'500.00	0.03	a)	
CH0101526678	2.6250 % AFDB 2 5/8 03/25/19 EMTN	1'235	0	100	1'135	1'135	CHF	105.30%	1'195'155.00	0.06	a)	
CH0101589353	3.6250 % RABOBK 3 5/8 07/02/19 EMTN	1'410	0	100	1'310	1'310	CHF	107.55%	1'408'905.00	0.07	a)	
CH0101768064	2.7500 % SNCF 2 3/4 06/11/18 EMTN	800	0	100	700	700	CHF	102.96%	720'720.00	0.04	a)	
CH0103078231	3.0000 % RESFER 3 04/24/19 EMTN	1'150	0	100	1'050	1'050	CHF	105.95%	1'112'475.00	0.05	a)	
CH0103164577	3.3750 % BKWSW 3 3/8 07/29/19	1'970	0	100	1'870	1'870	CHF	106.95%	1'999'965.00	0.10	a)	
CH0103165012	2.5000 % TESSIN 2 1/2 11/04/21	1'200	0	100	1'100	1'100	CHF	111.65%	1'228'150.00	0.06	a)	
CH0103165046	2.1250 % EUROF 2 1/8 11/10/17	1'055	0	1'055	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0104007577	2.8750 % CFF 2 7/8 09/10/19 EMTN	950	0	100	850	850	CHF	107.25%	911'625.00	0.04	a)	
CH0104493058	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 09/10/18 1	1'500	0	0	1'500	1'500	CHF	103.19%	1'547'850.00	0.08	a)	
CH0104691628	3.2500 % SCMNFX 3 1/4 09/14/18	4'500	0	100	4'400	4'400	CHF	104.15%	4'582'600.00	0.22	a)	
CH0104760001	2.3750 % KBLUZE 2 3/8 09/10/18	500	0	0	500	500	CHF	103.22%	516'100.00	0.03	a)	
CH0105134891	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/15/17 396	1'030	0	1'030	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0105134925	2.6250 % PFZENT 2 5/8 09/16/21 397	1'000	0	100	900	900	CHF	111.73%	1'005'570.00	0.05	a)	
CH0105202995	4.0000 % LHNFX 4 09/11/18 EMTN	1'880	0	100	1'780	1'780	CHF	104.55%	1'860'990.00	0.09	a)	
CH0105335498	2.2500 % ICO 2 1/4 11/07/17 EMTN	970	0	970	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0105376641	2.5000 % BNG 2 1/2 10/14/19 EMTN	600	0	100	500	500	CHF	106.95%	534'750.00	0.03	a)	
CH0105994203	2.5000 % CAFFIL 2 1/2 05/02/18	3'620	0	500	3'120	3'120	CHF	102.24%	3'189'888.00	0.16	a)	
CH0106848440	2.5000 % GENEVA 2 1/2 11/27/19	500	0	100	400	400	CHF	106.75%	427'000.00	0.02	a)	
CH0106942508	2.3750 % SNCF 2 3/8 07/24/19 EMTN	620	0	100	520	520	CHF	105.40%	548'080.00	0.03	a)	
CH0107012129	2.5000 % BERN 2 1/2 11/26/21	500	0	100	400	400	CHF	111.90%	447'600.00	0.02	a)	
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	1'950	0	0	1'950	1'950	CHF	120.30%	2'345'850.00	0.11	a)	
CH0107134717	2.2500 % KFW 2 1/4 08/12/20	3'050	0	100	2'950	2'950	CHF	108.55%	3'202'225.00	0.16	a)	
CH0107212968	2.5000 % ONT 2 1/2 12/04/19 EMTN	1'045	0	100	945	945	CHF	107.10%	1'012'095.00	0.05	a)	
CH0107559392	2.8750 % Q 2 7/8 12/17/21 EMTN	860	0	100	760	760	CHF	113.80%	864'880.00	0.04	a)	
CH0107685445	2.5000 % KBBL 2 1/2 12/16/19	650	0	100	550	550	CHF	106.75%	587'125.00	0.03	a)	
CH0107746130	3.1250 % WSTP 3 1/8 12/21/18 EMTN	800	200	100	900	900	CHF	104.95%	944'550.00	0.05	a)	
CH0107991892	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 01/07/22 1	1'800	0	100	1'700	1'700	CHF	111.40%	1'893'800.00	0.09	a)	
CH0108071116	2.1250 % ZUGKAN 2 1/8 12/22/17 1	960	0	960	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0108734846	2.1250 % ZKB 2 1/8 02/05/18 109	1'840	0	1'840	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0108785608	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 10/30/19 508	1'990	0	100	1'890	1'890	CHF	106.38%	2'010'582.00	0.10	a)	
CH0109117579	2.1250 % SBAB 2 1/8 02/15/17 EMTN	1'030	0	1'030	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0109152741	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 06/10/20	500	0	100	400	400	CHF	107.15%	428'600.00	0.02	a)	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	0	300	0	300	300	CHF	118.45%	355'350.00	0.02	a)	
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	1'300	0	0	1'300	1'300	CHF	129.65%	1'685'450.00	0.08	a)	
CH0109361813	2.2500 % DANBNK 2 1/4 09/12/17 EMTN	250	0	250	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0109411238	2.3750 % BNG 2 3/8 11/19/19 EMTN	1'030	0	100	930	930	CHF	106.85%	993'705.00	0.05	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0109559580	2.0000 % PFZENT 2 02/09/18 399	3'420	0	3'420	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0109559598	2.5000 % PFZENT 2 1/2 02/11/22 400	500	0	0	500	CHF	112.06%	560'300.00	0.03	a)	
CH0109674470	2.6250 % AXPOSW 2 5/8 02/26/20	1'170	0	0	1'170	CHF	105.75%	1'237'275.00	0.06	a)	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	1'500	0	0	1'500	CHF	110.65%	1'659'750.00	0.08	a)	
CH0109736824	2.3750 % CIFEUR 2 3/8 03/05/19	1'210	0	100	1'110	CHF	104.80%	1'163'280.00	0.06	a)	
CH0109889128	2.1250 % STAAKA 2 1/8 07/04/18 EMTN	1'100	0	100	1'000	CHF	102.57%	1'025'700.00	0.05	a)	
CH0109987112	2.2500 % NEDWBK 2 1/4 09/03/19 EMTN	1'000	0	100	900	CHF	106.10%	954'900.00	0.05	a)	
CH0110118566	2.1250 % KWLILI 2 1/8 03/10/17	1'035	0	1'035	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0110118574	2.7500 % KWLILI 2 3/4 03/10/22	0	300	0	300	CHF	108.20%	324'600.00	0.02	a)	
CH0110335871	2.1250 % NIEDOE 2 1/8 08/15/17	620	0	620	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0110346225	2.1250 % EIB 2 1/8 01/22/20	2'120	0	100	2'020	CHF	107.10%	2'163'420.00	0.11	a)	
CH0110442859	3.3750 % CS 3 3/8 03/16/20 EMTN	1'060	0	100	960	CHF	108.25%	1'039'200.00	0.05	a)	
CH0110493225	2.3750 % BERN 2 3/8 03/25/22	700	0	0	700	CHF	112.00%	784'000.00	0.04	a)	
CH0110680714	2.5000 % KKWLEB 2 1/2 03/29/19	950	300	100	1'150	CHF	103.50%	1'190'250.00	0.06	a)	
CH0110798540	1.7500 % KUNTA 1 3/4 05/26/17 EMTN	250	0	250	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0110814065	2.5000 % BCVAUD 2 1/2 03/25/20	0	450	0	450	CHF	107.40%	483'300.00	0.02	a)	
CH0111007206	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 02/25/20 511	4'700	0	0	4'700	CHF	106.82%	5'020'540.00	0.24	a)	
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	1'100	0	0	1'100	CHF	125.69%	1'382'590.00	0.07	a)	
CH0111191133	2.5000 % GENEVA 2 1/2 04/06/22 1	250	0	0	250	CHF	112.40%	281'000.00	0.01	a)	
CH0111825805	1.7500 % PFZENT 1 3/4 04/12/17 401	840	0	840	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0111999816	2.0000 % SWISS 2 04/28/21	19'794	0	800	18'994	CHF	109.75%	20'845'915.00	1.03	a)	
CH0112086951	2.1250 % BNG 2 1/8 11/06/18 EMTN	1'130	0	100	1'030	CHF	103.49%	1'065'947.00	0.05	a)	
CH0112138794	2.3750 % ONT 2 3/8 05/07/20 EMTN	1'430	0	100	1'330	CHF	107.90%	1'435'070.00	0.07	a)	
CH0112262933	2.1250 % EBN 2 1/8 04/27/20 1	1'530	0	100	1'430	CHF	106.90%	1'528'670.00	0.07	a)	
CH0112272783	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/12/20 111	1'000	500	100	1'400	CHF	106.45%	1'490'300.00	0.07	a)	
CH0112403875	2.2500 % SGKNSW 2 1/4 05/11/20	400	0	100	300	CHF	107.00%	321'000.00	0.02	a)	
CH0112933483	2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23	1'000	0	0	1'000	CHF	113.95%	1'139'500.00	0.06	a)	
CH0112933756	1.8750 % KTBS 1 7/8 05/31/19	1'600	1'000	100	2'500	CHF	104.45%	2'611'250.00	0.13	a)	
CH0113480161	2.1250 % GENEVA 2 1/8 06/15/20	1'400	0	100	1'300	CHF	107.15%	1'392'950.00	0.07	a)	
CH0113678400	1.7500 % KBBL 1 3/4 06/25/19	950	0	100	850	CHF	104.10%	884'850.00	0.04	a)	
CH0113982562	2.1250 % ZKB 2 1/8 06/29/22 113	2'530	0	0	2'530	CHF	110.80%	2'803'240.00	0.14	a)	
CH0114260257	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 06/28/23 514	4'280	0	0	4'280	CHF	112.58%	4'818'424.00	0.24	a)	
CH0114261446	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 06/30/20	2'050	0	100	1'950	CHF	106.25%	2'071'875.00	0.10	a)	
CH0114695379	2.6250 % SCMNVX 2 5/8 08/31/22	2'920	0	0	2'920	CHF	113.25%	3'306'900.00	0.16	a)	
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	1'250	0	0	1'250	CHF	113.40%	1'417'500.00	0.07	a)	
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	1'300	0	0	1'300	CHF	118.65%	1'542'450.00	0.08	a)	
CH0114839266	2.3750 % KWHINT 2 3/8 07/28/22	280	0	0	280	CHF	108.50%	303'800.00	0.01	a)	
CH0115013226	1.8750 % NEDWBK 1 7/8 02/03/20 EMTN	2'400	0	100	2'300	CHF	106.15%	2'441'450.00	0.12	a)	
CH0115108109	2.0000 % CIFEUR 2 01/30/19 EMTN	700	400	100	1'000	CHF	103.85%	1'038'500.00	0.05	a)	
CH0115457670	2.0000 % RABOBK 2 09/16/21 EMTN	3'440	0	100	3'340	CHF	108.50%	3'623'900.00	0.18	a)	
CH0115595487	2.0000 % EIB 2 08/24/22 EMTN	4'050	0	0	4'050	CHF	111.90%	4'531'950.00	0.22	a)	
CH0115967389	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 05/13/20 518	1'730	0	100	1'630	CHF	106.23%	1'731'549.00	0.08	a)	
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	2'050	0	0	2'050	CHF	123.43%	2'530'315.00	0.12	a)	
CH0116103489	1.7500 % ACACB 1 3/4 07/27/17 EMTN	1'150	0	1'150	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	2'980	0	0	2'980	CHF	114.10%	3'400'180.00	0.17	a)	
CH0116492213	1.2500 % THURBK 1 1/4 09/15/17	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0116706752	1.5000 % PFZENT 1 1/2 09/03/20 403	3'000	0	100	2'900	CHF	105.68%	3'064'720.00	0.15	a)	
CH0117076155	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 05/22/18 523	1'360	0	100	1'260	CHF	101.65%	1'280'790.00	0.06	a)	
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	3'890	0	0	3'890	CHF	117.33%	4'564'137.00	0.22	a)	
CH0117606472	2.0000 % MIGROS 2 05/03/17	510	0	510	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0117615143	1.8750 % ZUGKAN 1 7/8 10/14/20	900	0	100	800	CHF	106.90%	855'200.00	0.04	a)	
CH0117615374	2.2500 % CFF 2 1/4 10/13/21 EMTN	2'190	0	100	2'090	CHF	110.60%	2'311'540.00	0.11	a)	
CH0117683794	2.8750 % BALHOL 2 7/8 10/14/20	500	0	100	400	CHF	109.15%	436'600.00	0.02	a)	
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	1'330	0	0	1'330	CHF	113.20%	1'505'560.00	0.07	a)	
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	100	0	0	100	CHF	113.80%	113'800.00	0.01	a)	
CH0118109773	1.5000 % KBBS 1 1/2 10/26/18	600	0	0	600	CHF	102.50%	615'000.00	0.03	a)	
CH0118173803	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 10/18/17 527	2'200	0	2'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0118173829	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 08/03/20 528	2'400	0	100	2'300	CHF	105.92%	2'436'160.00	0.12	a)	
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	1'280	0	0	1'280	CHF	116.25%	1'488'000.00	0.07	a)	
CH0118607909	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/09/20	500	0	100	400	CHF	106.50%	426'000.00	0.02	a)	
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	900	250	300	850	CHF	120.30%	1'022'550.00	0.05	a)	
CH0119015060	1.7500 % PFZENT 1 3/4 11/01/19 404	1'820	500	100	2'220	CHF	104.97%	2'330'334.00	0.11	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	2'975	0	0	2'975	CHF	114.72%	3'412'920.00	0.17	a)	
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	750	0	0	750	CHF	123.10%	923'250.00	0.05	a)	
CH0119533278	3.1250 % CS 3 1/8 11/12/30 EMTN	765	0	0	765	CHF	120.25%	919'912.50	0.04	a)	
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'540	0	0	2'540	CHF	120.55%	3'061'970.00	0.15	a)	
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	1'565	0	0	1'565	CHF	118.80%	1'859'220.00	0.09	a)	
CH0120057804	1.7500 % ZUGKAN 1 3/4 12/03/19	0	500	0	500	CHF	104.85%	524'250.00	0.03	a)	
CH0120096398	1.7500 % DBHNGR 1 3/4 06/03/20 EMTN	4'450	0	100	4'350	CHF	106.40%	4'628'400.00	0.23	a)	
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	1'000	0	0	1'000	CHF	118.48%	1'184'800.00	0.06	a)	
CH0120401325	1.8750 % INTNED 1 7/8 08/29/18 EMTN	850	0	100	750	CHF	102.81%	771'075.00	0.04	a)	
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	730	0	0	730	CHF	124.45%	908'485.00	0.04	a)	
CH0120743346	2.0000 % HSBC 2 04/23/19 EMTN	1'980	0	100	1'880	CHF	104.05%	1'956'140.00	0.10	a)	
CH0122456756	2.0000 % ZKB 2 01/21/21 117	1'040	250	100	1'190	CHF	107.65%	1'281'035.00	0.06	a)	
CH0122488411	2.3750 % GRANDX 2 3/8 06/10/21	310	0	100	210	CHF	106.50%	223'650.00	0.01	a)	
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	1'860	0	0	1'860	CHF	117.95%	2'193'870.00	0.11	a)	
CH0122526608	2.6250 % ENAG 2 5/8 01/31/23	580	0	580	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0122787564	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/25/20 539	2'070	0	100	1'970	CHF	108.08%	2'129'176.00	0.10	a)	
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	1'890	0	0	1'890	CHF	115.05%	2'174'445.00	0.11	a)	
CH0122951673	2.3750 % BNPPCB 2 3/8 10/07/20 EMTN	620	0	100	520	CHF	108.40%	563'680.00	0.03	a)	
CH0122956177	1.6250 % KUNTA 1 5/8 02/07/18 EMTN	1'200	0	1'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0123385756	2.2500 % SNCF 2 1/4 02/25/21 EMTN	200	0	0	200	CHF	108.25%	216'500.00	0.01	a)	
CH0123555424	2.2500 % ABNAV 2 1/4 07/10/18 EMTN	500	0	100	400	CHF	102.80%	411'200.00	0.02	a)	
CH0123575091	2.1250 % MSTKEP 2 1/8 02/14/20 EMTN	2'580	0	100	2'480	CHF	105.95%	2'627'560.00	0.13	a)	
CH0123590991	2.2500 % GENEVA 2 1/4 02/22/21	900	1'000	0	1'900	CHF	108.90%	2'069'100.00	0.10	a)	
CH0123918424	2.2500 % STAAKA 2 1/4 02/22/21 EMTN	500	0	0	500	CHF	109.15%	545'750.00	0.03	a)	
CH0124071959	2.2500 % BNG 2 1/4 02/23/21 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	109.40%	1'312'800.00	0.06	a)	
CH0124131001	2.2500 % THURBK 2 1/4 02/25/21	490	0	0	490	CHF	108.65%	532'385.00	0.03	a)	
CH0124138816	2.0000 % PSHYPO 2 09/27/19 543	740	0	100	640	CHF	105.30%	673'920.00	0.03	a)	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	3'510	0	1'000	2'510	CHF	120.58%	3'026'558.00	0.15	a)	
CH0124205532	2.2500 % NEDWBK 2 1/4 02/24/21 EMTN	2'040	0	0	2'040	CHF	109.60%	2'235'840.00	0.11	a)	
CH0124295764	2.1250 % OKB 2 1/8 07/23/19	1'620	0	100	1'520	CHF	105.45%	1'602'840.00	0.08	a)	
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	1'190	0	0	1'190	CHF	127.05%	1'511'895.00	0.07	a)	
CH0124470904	2.1250 % KOMMUN 2 1/8 10/09/20 EMT	1'520	0	100	1'420	CHF	108.40%	1'539'280.00	0.08	a)	
CH0124656247	2.1250 % PFZENT 2 1/8 02/21/20 408	1'990	0	100	1'890	CHF	106.48%	2'012'472.00	0.10	a)	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	250	0	0	250	CHF	118.80%	297'000.00	0.01	a)	
CH0124853604	2.6250 % SGSNVX 2 5/8 03/08/19	2'920	0	1'100	1'820	CHF	104.65%	1'904'630.00	0.09	a)	
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	126.55%	2'720'825.00	0.13	a)	
CH0125062262	2.5000 % CRH 2 1/2 03/29/21 EMTN	1'980	0	100	1'880	CHF	110.15%	2'070'820.00	0.10	a)	
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	680	200	0	880	CHF	133.60%	1'175'680.00	0.06	a)	
CH0125269230	2.1250 % DANBNK 2 1/8 05/17/18 EMTN	980	0	100	880	CHF	102.15%	898'920.00	0.04	a)	
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	750	0	0	750	CHF	137.85%	1'033'875.00	0.05	a)	
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	1'320	0	0	1'320	CHF	119.65%	1'579'380.00	0.08	a)	
CH0126183075	2.3750 % ZKB 2 3/8 03/29/23 119	500	0	0	500	CHF	113.35%	566'750.00	0.03	a)	
CH0126434262	2.3750 % HSBC 2 3/8 04/04/18 EMTN	1'350	0	1'350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0126516043	2.6250 % INTNED 2 5/8 03/23/21 EMTN	1'330	0	100	1'230	CHF	110.15%	1'354'845.00	0.07	a)	
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	600	0	0	600	CHF	119.36%	716'160.00	0.03	a)	
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	1'130	0	0	1'130	CHF	136.85%	1'546'405.00	0.08	a)	
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'010	0	0	1'010	CHF	118.25%	1'194'325.00	0.06	a)	
CH0127181011	2.0000 % SWISS 2 05/25/22	15'887	4'450	1'000	19'337	CHF	112.02%	21'661'307.40	1.07	a)	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	8'799	900	0	9'699	CHF	128.10%	12'424'419.00	0.61	a)	
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	18'562	0	1'500	17'062	CHF	126.90%	21'651'678.00	1.07	a)	
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	14'974	1'000	1'250	14'724	CHF	110.37%	16'250'878.80	0.80	a)	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	16'164	0	0	16'164	CHF	117.60%	19'008'864.00	0.94	a)	
CH0127350368	2.1250 % PFZENT 2 1/8 04/06/20 409	1'130	400	100	1'430	CHF	106.73%	1'526'239.00	0.07	a)	
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	1'700	0	0	1'700	CHF	118.29%	2'010'930.00	0.10	a)	
CH0127593140	2.2500 % RY 2 1/4 04/21/21 EMTN	2'150	0	100	2'050	CHF	109.85%	2'251'925.00	0.11	a)	
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	113.80%	2'446'700.00	0.12	a)	
CH0128114441	2.1250 % ZKB 2 1/8 04/15/19 121	500	0	100	400	CHF	104.30%	417'200.00	0.02	a)	
CH0128250583	3.3750 % LHNVDX 3 3/8 06/10/21 EMTN	2'260	0	100	2'160	CHF	112.65%	2'433'240.00	0.12	a)	
CH0128705214	2.3750 % RAIFFS 2 3/8 05/10/18	2'130	0	100	2'030	CHF	102.22%	2'075'066.00	0.10	a)	
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	1'030	0	0	1'030	CHF	126.20%	1'299'860.00	0.06	a)	
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	2'060	0	0	2'060	CHF	122.63%	2'526'178.00	0.12	a)	
CH0129040777	2.2500 % FHZNSW 2 1/4 05/05/17	710	0	710	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0129057367	2.3750 % WKBNSW 2 3/8 05/18/21	280	0	100	180	CHF	109.45%	197'010.00	0.01	a)	
CH0129410988	2.3750 % ZUGKAN 2 3/8 05/25/21	1'910	0	100	1'810	CHF	109.75%	1'986'475.00	0.10	a)	
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	3'270	0	0	3'270	CHF	136.85%	4'474'995.00	0.22	a)	
CH0130036566	3.0000 % SGSNVX 3 05/27/21	850	0	100	750	CHF	111.85%	838'875.00	0.04	a)	
CH0130104125	2.2500 % KBFRI 2 1/4 06/14/21	570	0	100	470	CHF	109.25%	513'475.00	0.03	a)	
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	570	500	0	1'070	CHF	129.05%	1'380'835.00	0.07	a)	
CH0130420539	1.7500 % OKB 1 3/4 06/14/17 EMTN	1'610	0	1'610	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0130433995	2.5000 % GIVNVX 2 1/2 06/15/18	1'170	0	100	1'070	CHF	102.61%	1'097'927.00	0.05	a)	
CH0130501304	2.7500 % KWLILI 2 3/4 06/09/23	570	0	0	570	CHF	107.70%	613'890.00	0.03	a)	
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	400	0	0	400	CHF	120.95%	483'800.00	0.02	a)	
CH0130720516	2.6250 % SGKNSW 2 5/8 06/30/21	850	0	100	750	CHF	108.90%	816'750.00	0.04	a)	
CH0131078435	3.0000 % ENELIM 3 06/23/20 EMTN	500	400	100	800	CHF	108.45%	867'600.00	0.04	a)	
CH0131610740	2.2500 % PFZENT 2 1/4 06/16/23 411	2'825	0	0	2'825	CHF	113.10%	3'195'075.00	0.16	a)	
CH0131804616	3.0000 % BALHOL 3 07/07/21	2'250	0	100	2'150	CHF	111.35%	2'394'025.00	0.12	a)	
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	490	0	0	490	CHF	101.85%	499'065.00	0.02	a)	
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	1'000	0	0	1'000	CHF	117.37%	1'173'700.00	0.06	a)	
CH0133278686	2.2500 % CFF 2 1/4 08/09/19 EMTN	1'000	0	100	900	CHF	105.75%	951'750.00	0.05	a)	
CH0134637187	1.5000 % DNBNO 1 1/2 02/24/17 EMTN	2'310	0	2'310	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0135176318	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 05/24/17 555	930	0	930	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0136594337	1.6250 % EBN 1 5/8 10/03/23 EMTN	130	500	0	630	CHF	109.95%	692'685.00	0.03	a)	
CH0136594386	2.0000 % PM 2 12/06/21	750	0	200	550	CHF	108.40%	596'200.00	0.03	a)	
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	570	500	0	1'070	CHF	114.35%	1'223'545.00	0.06	a)	
CH0136846992	1.3750 % PFZENT 1 3/8 09/02/21 412	3'310	0	100	3'210	CHF	106.52%	3'419'292.00	0.17	a)	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	2'260	0	0	2'260	CHF	113.19%	2'558'094.00	0.12	a)	
CH0137659469	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/22 557	2'850	0	0	2'850	CHF	108.30%	3'086'550.00	0.15	a)	
CH0138460958	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 09/27/21	200	0	100	100	CHF	106.70%	106'700.00	0.01	a)	
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	0	400	0	400	CHF	110.65%	442'600.00	0.02	a)	
CH0138775876	2.8750 % KORGAS 2 7/8 10/11/19 GMTN	500	0	100	400	CHF	106.30%	425'200.00	0.02	a)	
CH0139265000	2.2500 % ABBNVX 2 1/4 10/11/21	1'455	0	100	1'355	CHF	109.40%	1'482'370.00	0.07	a)	
CH0139285388	1.5000 % LANHYP 1 1/2 10/24/18 EMTN	1'170	0	100	1'070	CHF	102.45%	1'096'215.00	0.05	a)	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	2'040	0	0	2'040	CHF	110.05%	2'245'020.00	0.11	a)	
CH0140410116	2.2500 % ADUHOL 2 1/4 10/27/17	1'120	0	1'120	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	400	0	0	400	CHF	111.40%	445'600.00	0.02	a)	
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	1'100	0	0	1'100	CHF	110.99%	1'220'890.00	0.06	a)	
CH0141428216	1.1250 % KBAARG 1 1/8 11/15/18	1'150	0	0	1'150	CHF	102.12%	1'174'380.00	0.06	a)	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	3'270	0	2'000	1'270	CHF	111.65%	1'417'955.00	0.07	a)	
CH0141835576	2.3750 % ZURNVX 2 3/8 11/23/18 EMTN	2'070	500	100	2'470	CHF	103.50%	2'556'450.00	0.12	a)	
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	2'200	0	0	2'200	CHF	111.50%	2'453'000.00	0.12	a)	
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	2'200	0	0	2'200	CHF	127.40%	2'802'800.00	0.14	a)	
CH0142821393	2.1250 % DGFP 2 1/8 12/15/17 EMTN	530	0	530	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0142821401	1.7500 % TLSAU 1 3/4 12/14/18 EMTN	600	0	100	500	CHF	102.63%	513'150.00	0.03	a)	
CH0142821443	1.0000 % NEDWBK 1 02/01/18 EMTN	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0142878344	1.0000 % ZKB 1 12/14/18 123	850	0	0	850	CHF	102.05%	867'425.00	0.04	a)	
CH0142882007	2.0000 % SBAB 2 12/06/18 EMTN	400	0	100	300	CHF	103.11%	309'330.00	0.02	a)	
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	700	0	0	700	CHF	108.95%	762'650.00	0.04	a)	
CH0142981940	2.1250 % GIVNVX 2 1/8 12/07/21	900	0	100	800	CHF	109.20%	873'600.00	0.04	a)	
CH0143218441	3.1250 % LONNVX 3 1/8 12/07/18	460	0	100	360	CHF	104.12%	374'832.00	0.02	a)	
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	150	0	0	150	CHF	111.10%	166'650.00	0.01	a)	
CH0143383963	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/30/21 558	3'520	1'200	200	4'520	CHF	106.82%	4'828'264.00	0.24	a)	
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	2'530	0	0	2'530	CHF	118.92%	3'008'676.00	0.15	a)	
CH0143838032	1.5000 % ANZ 1 1/2 02/13/19 EMTN	2'030	0	100	1'930	CHF	103.25%	1'992'725.00	0.10	a)	
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN	500	0	0	500	CHF	109.30%	546'500.00	0.03	a)	
CH0144279061	1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/15/21 417	3'400	0	100	3'300	CHF	107.00%	3'531'000.00	0.17	a)	
CH0146652158	1.2500 % ZKB 1 1/4 01/31/22 124	1'550	0	200	1'350	CHF	106.10%	1'432'350.00	0.07	a)	
CH0146696528	1.5000 % ABBNVX 1 1/2 11/23/18	750	400	100	1'050	CHF	102.45%	1'075'725.00	0.05	a)	
CH0146698425	1.2500 % EIB 1 1/4 08/02/19	550	0	100	450	CHF	103.95%	467'775.00	0.02	a)	
CH0146843443	1.1250 % KBFRI 2 1/8 02/01/22	400	0	0	400	CHF	105.30%	421'200.00	0.02	a)	
CH0147023466	2.0000 % RABOBK 2 02/06/19 EMTN	1'070	0	100	970	CHF	103.50%	1'003'950.00	0.05	a)	
CH0147029299	2.5000 % HTHROW 2 1/2 02/08/17 EMTN	100	0	100	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	5'170	0	1'000	4'170	CHF	111.34%	4'642'878.00	0.23	a)	
CH0148295014	2.2500 % BALHOL 2 1/4 03/01/19	850	0	100	750	CHF	103.85%	778'875.00	0.04	a)	
CH0148295436	0.8750 % PFZENT 0 7/8 12/03/18 418	2'450	0	100	2'350	CHF	102.03%	2'397'705.00	0.12	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0148295451	1.2500 % PFZENT 1 1/4 02/03/22 419	3'980	1'000	0	4'980	CHF	106.35%	5'296'230.00	0.26	a)	
CH0148560995	3.0000 % IBESM 3 02/13/17 EMTN	700	0	700	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0148606079	1.6250 % CRH 1 5/8 03/05/19	1'100	0	100	1'000	CHF	103.35%	1'033'500.00	0.05	a)	
CH0148723965	1.0000 % CM 1 02/13/19 EMTN	1'950	0	100	1'850	CHF	102.30%	1'892'550.00	0.09	a)	
CH0148937649	1.2500 % KOMINS 1 1/4 02/28/22 EMTN	2'745	0	0	2'745	CHF	107.20%	2'942'640.00	0.14	a)	
CH0149176122	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 08/13/19 563	2'630	0	200	2'430	CHF	102.76%	2'497'068.00	0.12	a)	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	2'070	0	0	2'070	CHF	108.69%	2'249'883.00	0.11	a)	
CH0149182450	1.5000 % ANZNZ 1 1/2 02/27/18 EMTN	1'250	0	0	1'250	CHF	101.18%	1'264'750.00	0.06	a)	
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	4'130	0	0	4'130	CHF	112.65%	4'652'445.00	0.23	a)	
CH0149710771	1.8750 % KOROIL 1 7/8 03/08/17 EMTN	600	0	600	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0149897974	0.6250 % KBBL 0 5/8 02/27/18	970	0	500	470	CHF	100.73%	473'431.00	0.02	a)	
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	1'050	0	0	1'050	CHF	113.75%	1'194'375.00	0.06	a)	
CH0180006170	2.1250 % AMCAU 2 1/8 04/04/18 EMTN	960	0	960	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0180071463	1.5000 % CBAAU 1 1/2 09/13/19 EMTN	700	0	100	600	CHF	104.20%	625'200.00	0.03	a)	
CH0180428531	2.8750 % KWLLILI 2 7/8 03/27/42	1'030	0	0	1'030	CHF	91.95%	947'085.00	0.05	a)	
CH0180513068	1.0000 % ROSW 1 09/21/18	2'280	0	100	2'180	CHF	101.54%	2'213'572.00	0.11	a)	
CH0180513183	1.6250 % ROSW 1 5/8 09/23/22	900	400	0	1'300	CHF	108.25%	1'407'250.00	0.07	a)	
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	3'800	0	0	3'800	CHF	109.99%	4'179'620.00	0.20	a)	
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	500	0	0	500	CHF	112.60%	563'000.00	0.03	a)	
CH0181379774	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 04/25/18	1'620	0	1'620	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0181646883	2.5000 % PEMEX 2 1/2 04/10/19 EMTN	1'020	0	100	920	CHF	103.40%	951'280.00	0.05	a)	
CH0181915585	2.7500 % SLOVAK 2 3/4 04/25/22 EMTN	260	300	0	560	CHF	113.20%	633'920.00	0.03	a)	
CH0181915734	1.7500 % OKB 1 3/4 05/24/23	800	0	0	800	CHF	111.15%	889'200.00	0.04	a)	
CH0181932929	1.0000 % VAUD 1 06/07/22	990	400	0	1'390	CHF	105.90%	1'472'010.00	0.07	a)	
CH0181932945	0.7500 % TESSIN 0 3/4 06/11/20	570	0	100	470	CHF	103.00%	484'100.00	0.02	a)	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	250	0	0	250	CHF	108.25%	270'625.00	0.01	a)	
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	800	0	0	800	CHF	119.80%	958'400.00	0.05	a)	
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	500	0	0	500	CHF	111.85%	559'250.00	0.03	a)	
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	2'600	0	0	2'600	CHF	112.84%	2'933'840.00	0.14	a)	
CH0183141792	1.7500 % DNBNO 1 3/4 04/18/18 EMTN	1'150	0	500	650	CHF	101.60%	660'400.00	0.03	a)	
CH0183365128	1.5000 % TEVA 1 1/2 10/25/18	935	400	100	1'235	CHF	101.95%	1'259'082.50	0.06	a)	
CH0183366167	1.2500 % BQNCHT 1 1/4 04/26/21	280	600	100	780	CHF	105.00%	819'000.00	0.04	a)	
CH0183380721	1.3750 % ASBBNK 1 3/8 11/02/18 EMTN	645	0	100	545	CHF	102.45%	558'352.50	0.03	a)	
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	2'350	0	0	2'350	CHF	111.13%	2'611'555.00	0.13	a)	
CH0184183322	3.0000 % ALPHSW 3 05/16/22	1'450	0	0	1'450	CHF	106.70%	1'547'150.00	0.08	a)	
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	11'750	1'000	0	12'750	CHF	113.12%	14'422'800.00	0.70	a)	
CH0184250261	2.2500 % POLAND 2 1/4 05/15/18 EMTN	2'400	0	600	1'800	CHF	102.27%	1'840'860.00	0.09	a)	
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	1'100	0	0	1'100	CHF	115.05%	1'265'550.00	0.06	a)	
CH0184777255	1.1250 % CRH 1 1/8 09/21/17 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0184777271	1.8750 % CRH 1 7/8 05/23/22 EMTN	700	500	0	1'200	CHF	109.35%	1'312'200.00	0.06	a)	
CH0184911904	0.5000 % GENEVA 0 1/2 05/29/17	250	0	250	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0184911953	1.2500 % GENEVA 1 1/4 12/29/22	1'000	0	0	1'000	CHF	107.20%	1'072'000.00	0.05	a)	
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	785	0	0	785	CHF	111.25%	873'312.50	0.04	a)	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	1'980	0	0	1'980	CHF	111.92%	2'216'016.00	0.11	a)	
CH0185334973	1.0000 % LANSBK 1 05/29/19 EMTN	820	0	100	720	CHF	102.70%	739'440.00	0.04	a)	
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	700	0	0	700	CHF	110.35%	772'450.00	0.04	a)	
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	700	0	0	700	CHF	109.95%	769'650.00	0.04	a)	
CH0185843007	0.6250 % EBN 0 5/8 07/04/19	790	0	100	690	CHF	102.00%	703'800.00	0.03	a)	
CH0185843015	1.1250 % EBN 1 1/8 07/04/24	780	0	0	780	CHF	107.20%	836'160.00	0.04	a)	
CH0185843023	2.6250 % GLENLN 2 5/8 12/03/18 EMTN	1'800	0	100	1'700	CHF	103.48%	1'759'160.00	0.09	a)	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	1'590	0	0	1'590	CHF	111.90%	1'779'210.00	0.09	a)	
CH0185996458	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 03/15/19 567	2'760	0	100	2'660	CHF	102.05%	2'714'530.00	0.13	a)	
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	1'410	500	0	1'910	CHF	106.15%	2'027'465.00	0.10	a)	
CH0186163991	1.0000 % SIKA 1 07/12/18	790	0	100	690	CHF	101.31%	699'039.00	0.03	a)	
CH0186164007	1.7500 % SIKA 1 3/4 07/12/22	790	0	0	790	CHF	107.70%	850'830.00	0.04	a)	
CH0186472491	0.7500 % GRKPSW 0 3/4 06/14/19	250	500	100	650	CHF	102.20%	664'300.00	0.03	a)	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	500	0	0	500	CHF	107.60%	538'000.00	0.03	a)	
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	750	0	0	750	CHF	109.35%	820'125.00	0.04	a)	
CH0187218901	3.0000 % LHNWX 3 11/22/22	1'800	0	0	1'800	CHF	113.60%	2'044'800.00	0.10	a)	
CH0187694366	1.2500 % FHZNSW 1 1/4 07/03/20	1'050	0	100	950	CHF	104.15%	989'425.00	0.05	a)	
CH0187695553	2.0000 % LGT 2 07/02/19	250	0	100	150	CHF	104.40%	156'600.00	0.01	a)	
CH0188098740	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 06/25/19 EMTN	2'190	0	100	2'090	CHF	103.30%	2'158'970.00	0.11	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0188335365	1.7500 % SCMN VX 1 3/4 07/10/24	1'750	0	0	1'750	CHF	110.75%	1'938'125.00	0.09	a)	
CH0188726811	1.2500 % COOP SW 1 1/4 07/25/19	1'030	0	100	930	CHF	102.80%	956'040.00	0.05	a)	
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	1'800	0	0	1'800	CHF	111.35%	2'004'300.00	0.10	a)	
CH0188931841	1.3750 % ACACB 1 3/8 07/30/18 EMTN	400	0	100	300	CHF	102.06%	306'180.00	0.01	a)	
CH0188931932	1.1250 % NAB 1 1/8 11/07/18 EMTN	910	0	100	810	CHF	101.95%	825'795.00	0.04	a)	
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	2'000	0	0	2'000	CHF	108.06%	2'161'200.00	0.11	a)	
CH0189276030	1.8750 % ADENVX 1 7/8 12/18/17	975	0	975	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0189276055	2.6250 % ADENVX 2 5/8 12/18/20	380	250	100	530	CHF	109.30%	579'290.00	0.03	a)	
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	500	1'100	0	1'600	CHF	115.25%	1'844'000.00	0.09	a)	
CH0190125044	1.1250 % NDASS 1 1/8 10/02/20 EMTN	1'000	0	100	900	CHF	104.15%	937'350.00	0.05	a)	
CH0190125051	1.0000 % OKB 1 09/28/21	1'700	0	100	1'600	CHF	105.55%	1'688'800.00	0.08	a)	
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	108.85%	1'088'500.00	0.05	a)	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	2'870	0	0	2'870	CHF	113.13%	3'246'831.00	0.16	a)	
CH0192241252	1.0000 % PSHYPO 1 08/13/21 571	4'500	0	500	4'000	CHF	104.99%	4'199'600.00	0.20	a)	
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	1'650	0	0	1'650	CHF	110.01%	1'815'165.00	0.09	a)	
CH0192251863	1.5000 % CAF 1 1/2 09/11/18 EMTN	1'700	0	100	1'600	CHF	102.16%	1'634'560.00	0.08	a)	
CH0192892757	1.1250 % AMXLMM 1 1/8 09/12/18	2'200	0	100	2'100	CHF	101.50%	2'131'500.00	0.10	a)	
CH0192941083	0.1250 % KTBS 0 1/8 08/29/17	1'250	0	1'250	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0193069835	1.1250 % BNG 1 1/8 09/13/22 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	106.75%	2'135'000.00	0.10	a)	
CH0193265995	1.0000 % GLRNKB 1 09/21/22	250	0	0	250	CHF	105.10%	262'750.00	0.01	a)	
CH0193296990	1.0000 % PM 1 09/18/20 EMTN	1'900	0	100	1'800	CHF	103.35%	1'860'300.00	0.09	a)	
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	800	0	0	800	CHF	109.05%	872'400.00	0.04	a)	
CH0193486021	1.1250 % BZLNZ 1 1/8 09/20/19 EMTN	800	300	100	1'000	CHF	102.95%	1'029'500.00	0.05	a)	
CH0193717540	1.0000 % PFZENT 1 09/09/22 425	3'050	0	0	3'050	CHF	105.59%	3'220'495.00	0.16	a)	
CH0193744916	1.0000 % ZUGKAN 1 09/26/22	2'000	0	0	2'000	CHF	105.25%	2'105'000.00	0.10	a)	
CH0194112071	1.0000 % KBBL 1 10/04/22	2'550	0	0	2'550	CHF	105.25%	2'683'875.00	0.13	a)	
CH0194273162	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/15/18 573	600	0	0	600	CHF	100.66%	603'960.00	0.03	a)	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	4'100	0	0	4'100	CHF	110.62%	4'535'420.00	0.22	a)	
CH0194352271	0.7500 % KBSCHW 0 3/4 10/05/20	500	0	100	400	CHF	103.20%	412'800.00	0.02	a)	
CH0194405335	1.2500 % RABOBK 1 1/4 10/15/20 GMTN	500	0	100	400	CHF	104.45%	417'800.00	0.02	a)	
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	700	0	0	700	CHF	108.95%	762'650.00	0.04	a)	
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	500	0	0	500	CHF	106.95%	534'750.00	0.03	a)	
CH0194695208	1.0000 % GENEVA 1 10/26/22	1'500	0	0	1'500	CHF	105.65%	1'584'750.00	0.08	a)	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	500	0	0	500	CHF	108.85%	544'250.00	0.03	a)	
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	1'200	400	0	1'600	CHF	90.65%	1'450'400.00	0.07	a)	
CH0194958986	1.3750 % SHBASS 1 3/8 10/05/22 EMTN	800	0	0	800	CHF	106.50%	852'000.00	0.04	a)	
CH0195062028	2.0000 % LONNVX 2 10/11/18	900	0	100	800	CHF	102.33%	818'640.00	0.04	a)	
CH0195062036	3.0000 % LONNVX 3 10/11/22	250	0	0	250	CHF	112.80%	282'000.00	0.01	a)	
CH0195288102	1.1250 % ENGIFP 1 1/8 10/09/20 EMTN	700	0	200	500	CHF	103.50%	517'500.00	0.03	a)	
CH0195288193	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 EMTN	900	0	0	900	CHF	109.50%	985'500.00	0.05	a)	
CH0195512519	4.2500 % UCGIM 4 1/4 10/19/22 EMTN	300	0	0	300	CHF	117.85%	353'550.00	0.02	a)	
CH0195757254	2.7500 % ENELIM 2 3/4 12/17/18 EMTN	1'500	0	100	1'400	CHF	103.94%	1'455'160.00	0.07	a)	
CH0196124355	2.0000 % LITHUN 2 04/11/18	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0196770454	1.0000 % PSPNSW 1 02/08/19	1'000	0	100	900	CHF	101.75%	915'750.00	0.04	a)	
CH0196878661	1.1250 % EIB 1 1/8 04/26/23	1'500	0	0	1'500	CHF	108.05%	1'620'750.00	0.08	a)	
CH0196924036	1.0000 % KDB 1 10/29/18 EMTN	500	0	100	400	CHF	101.51%	406'040.00	0.02	a)	
CH0197368654	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/19 575	2'100	700	200	2'600	CHF	101.85%	2'648'100.00	0.13	a)	
CH0197841569	2.7180 % TELEFO 2.718 12/14/18 EMTN	1'060	300	100	1'260	CHF	103.92%	1'309'392.00	0.06	a)	
CH0198104579	1.0000 % RFLBNI 1 11/12/20 EMTN	500	0	100	400	CHF	103.60%	414'400.00	0.02	a)	
CH0198323484	1.0000 % THURBK 1 11/30/22	500	0	0	500	CHF	105.25%	526'250.00	0.03	a)	
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	150	0	0	150	CHF	128.55%	192'825.00	0.01	a)	
CH0198619444	1.0000 % KORAIL 1 11/16/18	650	400	100	950	CHF	101.40%	963'300.00	0.05	a)	
CH0198800291	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/15/19 426	1'100	500	100	1'500	CHF	101.91%	1'528'650.00	0.07	a)	
CH0198800325	1.0000 % PFZENT 1 02/13/23 427	3'000	0	0	3'000	CHF	105.78%	3'173'400.00	0.15	a)	
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	1'600	0	0	1'600	CHF	113.20%	1'811'200.00	0.09	a)	
CH0199382042	1.0000 % VALIAN 1 11/20/18	850	0	0	850	CHF	101.60%	863'600.00	0.04	a)	
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	750	0	0	750	CHF	109.05%	817'875.00	0.04	a)	
CH0199543528	0.5000 % ZURICH 0 1/2 12/03/20	1'770	400	100	2'070	CHF	102.95%	2'131'065.00	0.10	a)	
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	2'900	0	1'000	1'900	CHF	107.65%	2'045'350.00	0.10	a)	
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	800	0	0	800	CHF	110.95%	887'600.00	0.04	a)	
CH0199544781	2.1250 % MQGAU 2 1/8 11/29/18 EMTN	700	0	100	600	CHF	103.23%	619'380.00	0.03	a)	
CH0199544989	3.0000 % MQGAU 3 11/29/22 EMTN	810	0	0	810	CHF	114.90%	930'690.00	0.05	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe /	Verkufe /	Anzahl /		Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Tsd.			Nominal in	Tsd.						
		01.02.2017		31.07.2017									
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	3'430	0	0	3'430	CHF	106.93%	3'667'699.00	0.18	a)			
CH0199773224	0.3750 % SOLEUR 0 3/8 11/29/19	300	0	100	200	CHF	102.05%	204'100.00	0.01	a)			
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'950	0	0	1'950	CHF	110.45%	2'153'775.00	0.11	a)			
CH0200044771	1.5000 % NANTDR 1 1/2 02/15/21	1'360	0	100	1'260	CHF	103.05%	1'298'430.00	0.06	a)			
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	1'300	300	0	1'600	CHF	102.95%	1'647'200.00	0.08	a)			
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	300	0	0	300	CHF	108.20%	324'600.00	0.02	a)			
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	1'600	0	0	1'600	CHF	108.15%	1'730'400.00	0.08	a)			
CH0200252812	1.1250 % ANVAU 1 1/8 04/18/19 EMTN	1'600	0	100	1'500	CHF	102.35%	1'535'250.00	0.07	a)			
CH0200252820	1.5000 % CABEI 1 1/2 02/04/20	250	0	100	150	CHF	104.35%	156'525.00	0.01	a)			
CH0200252838	1.8750 % LGT 1 7/8 02/08/23	1'300	0	0	1'300	CHF	109.85%	1'428'050.00	0.07	a)			
CH0200370218	0.8750 % EGW 0 7/8 03/24/23 44	1'400	0	0	1'400	CHF	105.65%	1'479'100.00	0.07	a)			
CH0200404173	1.5000 % GS 1 1/2 11/29/18 EMTN	1'570	0	100	1'470	CHF	102.28%	1'503'516.00	0.07	a)			
CH0201225197	1.0000 % KDB 1 12/21/18 EMTN	500	500	100	900	CHF	101.71%	915'390.00	0.04	a)			
CH0201297212	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/13/18 577	2'250	0	100	2'150	CHF	100.97%	2'170'855.00	0.11	a)			
CH0201591705	0.8750 % PFZENT 0 7/8 06/20/22 428	3'300	0	0	3'300	CHF	104.95%	3'463'350.00	0.17	a)			
CH0203695629	0.8750 % KUNTA 0 7/8 02/01/23 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	106.15%	1'379'950.00	0.07	a)			
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	1'700	0	0	1'700	CHF	106.70%	1'813'900.00	0.09	a)			
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	107.30%	1'287'600.00	0.06	a)			
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	1'200	0	0	1'200	CHF	112.70%	1'352'400.00	0.07	a)			
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	750	0	0	750	CHF	109.70%	822'750.00	0.04	a)			
CH0204477241	2.2500 % BLDAU 2 1/4 02/20/20 EMTN	500	0	100	400	CHF	105.00%	420'000.00	0.02	a)			
CH0204477258	1.6250 % NAB 1 5/8 09/05/23 EMTN	1'100	0	0	1'100	CHF	108.80%	1'196'800.00	0.06	a)			
CH0204477290	1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23	1'950	0	0	1'950	CHF	108.00%	2'106'000.00	0.10	a)			
CH0204477688	0.8750 % CBAAU 0 7/8 02/11/20 EMTN	250	500	100	650	CHF	102.70%	667'550.00	0.03	a)			
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	3'450	0	0	3'450	CHF	110.20%	3'801'900.00	0.19	a)			
CH0204567322	1.3750 % CAF 1 3/8 02/11/21 EMTN	1'500	0	100	1'400	CHF	105.20%	1'472'800.00	0.07	a)			
CH0204574914	2.1250 % GASSM 2 1/8 02/08/19 EMTN	1'050	0	100	950	CHF	103.35%	981'825.00	0.05	a)			
CH0204678020	1.1250 % KORGAS 1 1/8 02/12/20 EMTN	1'330	0	100	1'230	CHF	103.10%	1'268'130.00	0.06	a)			
CH0204811076	1.0000 % SWISSG 1 01/30/20	210	0	100	110	CHF	102.95%	113'245.00	0.01	a)			
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	1'100	0	0	1'100	CHF	110.00%	1'210'000.00	0.06	a)			
CH0205276683	1.6250 % STMNSW 1 5/8 04/30/20	650	0	100	550	CHF	104.15%	572'825.00	0.03	a)			
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	1'500	0	0	1'500	CHF	113.10%	1'696'500.00	0.08	a)			
CH0205287706	0.8750 % ANZNZ 0 7/8 02/14/19 EMTN	600	0	100	500	CHF	101.80%	509'000.00	0.02	a)			
CH0205310904	1.1250 % KBSCHW 1 1/8 02/20/23	1'200	0	0	1'200	CHF	106.15%	1'273'800.00	0.06	a)			
CH0205409011	1.6250 % GS 1 5/8 02/06/20 EMTN	1'235	0	100	1'135	CHF	104.25%	1'183'237.50	0.06	a)			
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	500	0	0	500	CHF	121.80%	609'000.00	0.03	a)			
CH0205832618	1.1250 % Q 1 1/8 02/22/23 EMTN	600	0	0	600	CHF	106.95%	641'700.00	0.03	a)			
CH0206074871	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/19/18 579	2'550	0	2'550	0	CHF	0.00%	0.00	0.00				
CH0206368174	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/02/18 430	4'080	0	100	3'980	CHF	100.88%	4'015'024.00	0.20	a)			
CH0206594498	1.3750 % SLOVAK 1 3/8 10/16/19	1'650	0	100	1'550	CHF	103.90%	1'610'450.00	0.08	a)			
CH0206594506	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 10/16/23	950	0	0	950	CHF	112.35%	1'067'325.00	0.05	a)			
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	500	0	0	500	CHF	110.95%	554'750.00	0.03	a)			
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	2'250	0	0	2'250	CHF	109.35%	2'460'375.00	0.12	a)			
CH0206903764	0.8750 % PM 0 7/8 03/11/19	1'600	0	100	1'500	CHF	101.85%	1'527'750.00	0.07	a)			
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	1'150	0	0	1'150	CHF	110.45%	1'270'175.00	0.06	a)			
CH0207550010	1.1250 % BNG 1 1/8 04/19/23 EMTN	300	0	0	300	CHF	107.40%	322'200.00	0.02	a)			
CH0207960649	0.8750 % NDASS 0 7/8 09/25/18 EMTN	1'500	0	100	1'400	CHF	101.57%	1'421'980.00	0.07	a)			
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	500	0	0	500	CHF	92.80%	464'000.00	0.02	a)			
CH0208309291	1.0000 % INTNED 1 09/14/18 EMTN	600	400	100	900	CHF	101.46%	913'140.00	0.04	a)			
CH0208323441	1.2500 % GENEVA 1 1/4 03/22/23	700	0	0	700	CHF	107.25%	750'750.00	0.04	a)			
CH0208580693	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 03/28/23	400	500	0	900	CHF	106.25%	956'250.00	0.05	a)			
CH0208701380	1.1250 % KBBL 1 1/8 03/27/23	1'400	0	0	1'400	CHF	106.40%	1'489'600.00	0.07	a)			
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	800	0	0	800	CHF	116.05%	928'400.00	0.05	a)			
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	550	0	0	550	CHF	110.25%	606'375.00	0.03	a)			
CH0209472064	1.1250 % HELNSW 1 1/8 04/08/19	230	0	230	0	CHF	0.00%	0.00	0.00				
CH0209474631	1.7500 % LONNVX 1 3/4 04/10/19	2'150	0	100	2'050	CHF	102.75%	2'106'375.00	0.10	a)			
CH0209654984	1.1250 % LANSBK 1 1/8 04/11/23 EMTN	750	0	0	750	CHF	106.40%	798'000.00	0.04	a)			
CH0209675211	1.6250 % BFCM 1 5/8 04/11/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	108.05%	540'250.00	0.03	a)			
CH0209886511	1.0000 % KIWI 1 12/23/20 EMTN	380	0	100	280	CHF	104.20%	291'760.00	0.01	a)			
CH0210240302	0.8750 % PFZENT 0 7/8 04/16/21 431	2'100	0	100	2'000	CHF	104.25%	2'085'000.00	0.10	a)			
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	1'200	0	0	1'200	CHF	109.35%	1'312'200.00	0.06	a)			
CH0210362791	1.5000 % FHZNSW 1 1/2 04/17/23	800	950	0	1'750	CHF	107.85%	1'887'375.00	0.09	a)			

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0210384134	1.0000 % NAB 1 04/17/20 EMTN	1'300	0	100	1'200	CHF	103.20%	1'238'400.00	0.06	a)	
CH0210461312	1.1250 % KBSH 1 1/8 04/24/23	550	0	0	550	CHF	106.35%	584'925.00	0.03	a)	
CH0211588915	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 09/29/23 580	3'100	800	0	3'900	CHF	107.63%	4'197'570.00	0.20	a)	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	2'475	0	0	2'475	CHF	113.70%	2'814'075.00	0.14	a)	
CH0212184052	1.0000 % RELLN 1 12/18/18	900	0	100	800	CHF	101.39%	811'120.00	0.04	a)	
CH0212184060	1.1250 % SLHNVX 1 1/8 06/21/19	1'700	0	100	1'600	CHF	102.20%	1'635'200.00	0.08	a)	
CH0212184078	1.8750 % SLHNVX 1 7/8 06/21/23	700	0	0	700	CHF	109.15%	764'050.00	0.04	a)	
CH0212267337	1.7500 % BELLSW 1 3/4 05/16/22	100	0	0	100	CHF	107.80%	107'800.00	0.01	a)	
CH0212365818	0.8750 % ZKB 0 7/8 05/17/21 130	900	700	100	1'500	CHF	103.90%	1'558'500.00	0.08	a)	
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	2'200	0	0	2'200	CHF	117.10%	2'576'200.00	0.13	a)	
CH0212771601	1.1250 % BNCHIL 1 1/8 05/23/18	470	0	470	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0212937228	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 06/19/18	700	0	700	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0212937236	1.5000 % ACHMEA 1 1/2 06/19/19 EMTN	550	300	100	750	CHF	102.90%	771'750.00	0.04	a)	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	900	0	0	900	CHF	112.00%	1'008'000.00	0.05	a)	
CH0212937251	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/24/23 EMTN	1'450	0	0	1'450	CHF	108.15%	1'568'175.00	0.08	a)	
CH0213373290	0.8750 % SRBANK 0 7/8 11/30/18 EMTN	1'850	0	100	1'750	CHF	101.57%	1'777'475.00	0.09	a)	
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	300	0	0	300	CHF	119.50%	358'500.00	0.02	a)	
CH0214027606	0.8750 % ASBBNK 0 7/8 06/11/19 EMTN	900	0	100	800	CHF	102.15%	817'200.00	0.04	a)	
CH0214365618	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 04/15/19 582	2'200	0	200	2'000	CHF	101.72%	2'034'400.00	0.10	a)	
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	300	0	0	300	CHF	112.80%	338'400.00	0.02	a)	
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	500	0	0	500	CHF	125.60%	628'000.00	0.03	a)	
CH0214926088	1.6250 % EMMI 1 5/8 07/12/23 .	1'450	0	0	1'450	CHF	108.65%	1'575'425.00	0.08	a)	
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	2'000	0	0	2'000	CHF	111.80%	2'236'000.00	0.11	a)	
CH0215076313	1.6250 % KOWEPW 1 5/8 03/26/19 EMT	2'000	0	100	1'900	CHF	102.60%	1'949'400.00	0.10	a)	
CH0215076339	1.5000 % ABNANV 1 1/2 12/27/19 EMTN	900	0	100	800	CHF	104.20%	833'600.00	0.04	a)	
CH0215076354	1.7500 % BSANCI 1 3/4 09/26/19	700	0	100	600	CHF	103.80%	622'800.00	0.03	a)	
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'300	0	0	1'300	CHF	120.05%	1'560'650.00	0.08	a)	
CH0215645661	1.1250 % SPSNSW 1 1/8 07/11/18	500	0	100	400	CHF	101.15%	404'600.00	0.02	a)	
CH0215650711	2.0000 % KKGDSW 2 09/30/20	400	0	100	300	CHF	102.70%	308'100.00	0.02	a)	
CH0215650737	2.0000 % SPSNSW 2 10/21/20	800	0	100	700	CHF	105.45%	738'150.00	0.04	a)	
CH0215690402	1.1250 % MET 1 1/8 06/18/20 EMTN	950	0	100	850	CHF	103.60%	880'600.00	0.04	a)	
CH0216320710	1.2500 % SEK 1 1/4 07/17/23 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	108.20%	1'082'000.00	0.05	a)	
CH0217374286	1.1250 % OKB 1 1/8 07/24/20	2'500	0	100	2'400	CHF	104.80%	2'515'200.00	0.12	a)	
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	400	0	0	400	CHF	115.60%	462'400.00	0.02	a)	
CH0217677605	1.2500 % ENBW 1 1/4 07/12/18 EMTN	300	0	100	200	CHF	101.22%	202'440.00	0.01	a)	
CH0217677654	2.2500 % ENBW 2 1/4 07/12/23 EMTN	400	0	0	400	CHF	110.40%	441'600.00	0.02	a)	
CH0217678538	1.3750 % VORHYP 1 3/8 07/25/18 EMTN	1'520	0	100	1'420	CHF	101.61%	1'442'862.00	0.07	a)	
CH0217756631	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 05/10/21 583	2'850	0	100	2'750	CHF	105.69%	2'906'475.00	0.14	a)	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	3'450	0	0	3'450	CHF	112.44%	3'879'180.00	0.19	a)	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	1'100	0	0	1'100	CHF	115.55%	1'271'050.00	0.06	a)	
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	600	0	0	600	CHF	126.80%	760'800.00	0.04	a)	
CH0217850673	1.2500 % ZURICH 1 1/4 07/29/22	1'400	0	0	1'400	CHF	107.35%	1'502'900.00	0.07	a)	
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'000	0	0	1'000	CHF	113.25%	1'132'500.00	0.06	a)	
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	1'300	300	0	1'600	CHF	127.35%	2'037'600.00	0.10	a)	
CH0217986378	1.6250 % KOROIL 1 5/8 11/29/18 EMTN	550	0	100	450	CHF	102.28%	460'260.00	0.02	a)	
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	1'300	1'100	0	2'400	CHF	112.95%	2'710'800.00	0.13	a)	
CH0219080048	1.5000 % CAF 1 1/2 08/13/20 EMTN	1'000	0	100	900	CHF	105.15%	946'350.00	0.05	a)	
CH0220684614	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/15/22 585	5'360	0	0	5'360	CHF	107.46%	5'759'856.00	0.28	a)	
CH0221386136	1.5000 % GEOFIS 1 1/2 09/12/18	250	0	100	150	CHF	101.90%	152'850.00	0.01	a)	
CH0221386144	2.5000 % GEOFIS 2 1/2 09/12/22	150	0	0	150	CHF	111.00%	166'500.00	0.01	a)	
CH0221732040	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 09/13/22	100	0	0	100	CHF	107.90%	107'900.00	0.01	a)	
CH0221961730	1.2500 % BERN 1 1/4 09/20/21	1'200	0	100	1'100	CHF	106.25%	1'168'750.00	0.06	a)	
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	1'150	0	0	1'150	CHF	110.90%	1'275'350.00	0.06	a)	
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'000	0	0	1'000	CHF	122.90%	1'229'000.00	0.06	a)	
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'500	0	0	1'500	CHF	115.05%	1'725'750.00	0.08	a)	
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	650	0	0	650	CHF	120.95%	786'175.00	0.04	a)	
CH0222136506	1.1250 % PFZENT 1 1/8 06/12/20 438	3'000	0	100	2'900	CHF	104.25%	3'023'250.00	0.15	a)	
CH0222136654	2.0000 % ALLNSW 2 09/23/20	850	0	100	750	CHF	105.90%	794'250.00	0.04	a)	
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	1'750	0	0	1'750	CHF	111.40%	1'949'500.00	0.10	a)	
CH0222359421	1.2500 % SHBASS 1 1/4 12/20/19 EMTN	700	0	100	600	CHF	103.45%	620'700.00	0.03	a)	
CH0222418235	1.5000 % KORELE 1 1/2 04/23/19	600	0	100	500	CHF	102.80%	514'000.00	0.03	a)	
CH0222418268	2.5000 % BREPW 2 1/2 10/08/18 EMTN	750	0	100	650	CHF	103.03%	669'695.00	0.03	a)	



ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe /	Verkufe /	Anzahl /		Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.
		Nominal in	Tsd.			Nominal in	Tsd.					
		01.02.2017		2)	3)	31.07.2017						
CH0222418300	2.5950 % TELEFO 2.595 10/23/20 EMTN	1'700	0		100	1'600	CHF	107.55%	1'720'800.00	0.08	a)	
CH0222433291	1.0000 % CBAAU 1 09/25/18 EMTN	2'200	0		100	2'100	CHF	101.64%	2'134'440.00	0.10	a)	
CH0222705979	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 09/18/19	1'400	0		100	1'300	CHF	102.75%	1'335'750.00	0.07	a)	
CH0222705987	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/18/23	900	0	0		900	CHF	109.70%	987'300.00	0.05	a)	
CH0222760826	1.3750 % KBSCHW 1 3/8 09/24/21	1'300	0		100	1'200	CHF	106.25%	1'275'000.00	0.06	a)	
CH0223311959	1.0000 % GLRNKB 1 10/04/19	500	0		100	400	CHF	102.75%	411'000.00	0.02	a)	
CH0223523298	1.3750 % KDB 1 3/8 07/02/18 EMTN	800	0		100	700	CHF	101.54%	710'780.00	0.03	a)	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	8'170	1'300		0	9'470	CHF	111.41%	10'550'527.00	0.51	a)	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	8'450	500		0	8'950	CHF	156.80%	14'033'600.00	0.68	a)	
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	5'500	2'500		500	7'500	CHF	104.05%	7'803'750.00	0.38	a)	
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	7'400	600		0	8'000	CHF	101.37%	8'109'600.00	0.40	a)	
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	4'300	1'850		0	6'150	CHF	98.65%	6'066'975.00	0.30	a)	
CH0224397429	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 FEB	0	2'500		2'500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	2'000	0		0	2'000	CHF	123.05%	2'461'000.00	0.12	a)	
CH0224486362	0.7500 % RY 0 3/4 10/23/18 EMTN	2'200	0		100	2'100	CHF	101.47%	2'130'870.00	0.10	a)	
CH0224574647	1.5000 % WKBNSW 1 1/2 10/28/22	800	0		0	800	CHF	107.65%	861'200.00	0.04	a)	
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	450	0		0	450	CHF	122.85%	552'825.00	0.03	a)	
CH0224761509	1.1250 % SIKA 1 1/8 11/14/19	750	0		100	650	CHF	103.00%	669'500.00	0.03	a)	
CH0224761517	1.8750 % SIKA 1 7/8 11/14/23	600	0		0	600	CHF	109.85%	659'100.00	0.03	a)	
CH0224761525	0.5000 % ZURICH 0 1/2 06/06/19	600	550		100	1'050	CHF	101.85%	1'069'425.00	0.05	a)	
CH0224761533	1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23	1'350	0		0	1'350	CHF	109.15%	1'473'525.00	0.07	a)	
CH0224904018	1.1250 % ZUGKAN 1 1/8 10/29/20	700	0		100	600	CHF	104.50%	627'000.00	0.03	a)	
CH0224923497	1.5000 % MOBNSW 1 1/2 10/29/18	250	0		0	250	CHF	101.86%	254'650.00	0.01	a)	
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	200	0		0	200	CHF	112.20%	224'400.00	0.01	a)	
CH0225071585	0.8750 % HILTI 0 7/8 10/30/18	160	0		0	160	CHF	101.16%	161'856.00	0.01	a)	
CH0225071593	1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23	420	0		0	420	CHF	110.50%	464'100.00	0.02	a)	
CH0225173290	1.5000 % KORAIL 1 1/2 12/02/19	500	400		100	800	CHF	103.60%	828'800.00	0.04	a)	
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	1'350	0		0	1'350	CHF	111.25%	1'501'875.00	0.07	a)	
CH0225323283	1.1250 % ABNAV 1 1/8 10/25/18 EMTN	1'515	0		0	1'515	CHF	101.81%	1'542'421.50	0.08	a)	
CH0225710588	2.1250 % GLENLN 2 1/8 12/23/19 EMTN	700	0		100	600	CHF	104.65%	627'900.00	0.03	a)	
CH0225941464	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/31/17 439	1'500	0		1'500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0225941605	1.2500 % PFZENT 1 1/4 10/29/21 440	1'650	0		100	1'550	CHF	106.12%	1'644'860.00	0.08	a)	
CH0226752290	2.0000 % ULFP 2 11/20/23 EMTN	400	0		0	400	CHF	109.80%	439'200.00	0.02	a)	
CH0226869052	0.6250 % TESSIN 0 5/8 03/21/19	500	0		100	400	CHF	101.60%	406'400.00	0.02	a)	
CH0226869060	1.3750 % TESSIN 1 3/8 11/21/22	700	500		0	1'200	CHF	107.60%	1'291'200.00	0.06	a)	
CH0227343164	0.5000 % KTBS 0 1/2 11/28/18	1'200	0		100	1'100	CHF	101.43%	1'115'730.00	0.05	a)	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	500	0		0	500	CHF	108.25%	541'250.00	0.03	a)	
CH0227975528	1.1250 % CMBNSW 1 1/8 11/29/17	800	0		800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	700	0		0	700	CHF	110.85%	775'950.00	0.04	a)	
CH0228199243	2.8750 % ENAPCL 2 7/8 12/05/18	100	0		0	100	CHF	103.50%	103'500.00	0.01	a)	
CH0228207574	1.5000 % BNCHIL 1 1/2 12/03/19	375	0		100	275	CHF	103.95%	285'862.50	0.01	a)	
CH0228518533	1.5000 % CABEI 1 1/2 12/16/19 EMTN	600	0		100	500	CHF	104.30%	521'500.00	0.03	a)	
CH0228531452	2.0000 % LHN 2 06/09/22	1'200	0		0	1'200	CHF	107.60%	1'291'200.00	0.06	a)	
CH0228531478	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/20	700	0		100	600	CHF	103.75%	622'500.00	0.03	a)	
CH0228622384	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/16/23 586	1'800	0		0	1'800	CHF	108.50%	1'953'000.00	0.10	a)	
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	1'600	0		0	1'600	CHF	123.29%	1'972'640.00	0.10	a)	
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	600	0		0	600	CHF	129.60%	777'600.00	0.04	a)	
CH0229001000	1.2500 % CDCEPS 1 1/4 12/16/20	1'600	0		0	1'600	CHF	105.40%	1'686'400.00	0.08	a)	
CH0229318131	1.8750 % CABEI 1 7/8 02/25/22 EMTN	1'000	0		0	1'000	CHF	108.45%	1'084'500.00	0.05	a)	
CH0229571655	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/17 441	750	0		750	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0229571770	1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/12/22 442	1'800	0		0	1'800	CHF	107.74%	1'939'320.00	0.09	a)	
CH0229881138	1.3750 % PSPNSW 1 3/8 02/04/20	500	0		100	400	CHF	103.70%	414'800.00	0.02	a)	
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	1'000	0		0	1'000	CHF	127.45%	1'274'500.00	0.06	a)	
CH0232635869	1.3750 % BZLNZ 1 3/8 02/03/21 EMTN	500	0		100	400	CHF	105.15%	420'600.00	0.02	a)	
CH0232663549	1.1250 % ABNAV 1 1/8 01/31/19 EMTN	1'350	0		100	1'250	CHF	102.10%	1'276'250.00	0.06	a)	
CH0232698719	1.5000 % ZKB 1 1/2 01/27/23 132	500	0		0	500	CHF	108.20%	541'000.00	0.03	a)	
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	500	0		0	500	CHF	109.75%	548'750.00	0.03	a)	
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	1'250	0		0	1'250	CHF	112.70%	1'408'750.00	0.07	a)	
CH0233216016	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 03/03/21 588	2'750	0		100	2'650	CHF	105.07%	2'784'355.00	0.14	a)	
CH0233226213	1.6250 % RAIFFS 1 5/8 02/07/22	1'050	0		0	1'050	CHF	107.40%	1'127'700.00	0.06	a)	
CH0233226262	1.1250 % ASBBNK 1 1/8 02/05/20 EMTN	900	0		100	800	CHF	103.35%	826'800.00	0.04	a)	
CH0233341657	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 02/05/21	2'050	0		100	1'950	CHF	104.65%	2'040'675.00	0.10	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0233680203	1.5000 % LGT 1 1/2 05/10/21	1'600	0	100	1'500	CHF	105.70%	1'585'500.00	0.08	a)	
CH0233720660	1.1250 % BFCM 1 1/8 02/12/19 EMTN	400	0	100	300	CHF	102.15%	306'450.00	0.01	a)	
CH0233911772	1.5000 % CBAAU 1 1/2 02/07/22 EMTN	1'550	0	0	1'550	CHF	106.75%	1'654'625.00	0.08	a)	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	1'100	0	0	1'100	CHF	110.60%	1'216'600.00	0.06	a)	
CH0234274444	1.2500 % ALLNSW 1 1/4 04/02/19	600	0	100	500	CHF	102.15%	510'750.00	0.02	a)	
CH0234274493	1.7500 % SPSNSW 1 3/4 04/16/21	2'430	0	100	2'330	CHF	105.20%	2'451'160.00	0.12	a)	
CH0234487384	1.0000 % ANZNZ 1 03/10/20 EMTN	1'050	0	100	950	CHF	103.10%	979'450.00	0.05	a)	
CH0234487392	3.0000 % BPCLIN 3 12/20/19 EMTN	350	0	100	250	CHF	105.60%	264'000.00	0.01	a)	
CH0234487400	1.1250 % BENAU 1 1/8 03/25/19 EMTN	950	0	100	850	CHF	101.70%	864'450.00	0.04	a)	
CH0234487426	3.0000 % BHARTI 3 03/31/20	1'550	0	100	1'450	CHF	106.10%	1'538'450.00	0.08	a)	
CH0234833678	1.5000 % ISHZ 1 1/2 02/14/19	700	0	100	600	CHF	101.90%	611'400.00	0.03	a)	
CH0235034110	1.1250 % ACACB 1 1/8 08/12/21 EMTN	200	0	100	100	CHF	105.20%	105'200.00	0.01	a)	
CH0235475339	0.2500 % PFZENT 0 1/4 03/28/18 443	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0235475347	1.0000 % PFZENT 1 02/17/21 444	2'000	700	100	2'600	CHF	104.57%	2'718'820.00	0.13	a)	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	1'650	0	0	1'650	CHF	111.91%	1'846'515.00	0.09	a)	
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	1'000	500	0	1'500	CHF	109.95%	1'649'250.00	0.08	a)	
CH0236122724	1.3750 % SGSNVX 1 3/8 02/25/22	1'664	0	0	1'664	CHF	105.85%	1'761'344.00	0.09	a)	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	1'210	0	0	1'210	CHF	109.75%	1'327'975.00	0.06	a)	
CH0236331127	1.1250 % EIBKOR 1 1/8 09/03/19 EMTN	500	0	100	400	CHF	102.55%	410'200.00	0.02	a)	
CH0236516784	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 03/06/23	400	0	0	400	CHF	106.45%	425'800.00	0.02	a)	
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	400	0	0	400	CHF	114.65%	458'600.00	0.02	a)	
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	600	0	0	600	CHF	108.45%	650'700.00	0.03	a)	
CH0236686843	1.3750 % THURBK 1 3/8 08/28/23	660	0	0	660	CHF	108.00%	712'800.00	0.03	a)	
CH0236803992	1.0000 % COE 1 03/06/23 EMTN	350	0	0	350	CHF	106.65%	373'275.00	0.02	a)	
CH0237027252	0.6250 % SHBASS 0 5/8 12/11/18 EMTN	2'380	0	100	2'280	CHF	101.27%	2'308'956.00	0.11	a)	
CH0237552085	1.0000 % GIVNVX 1 09/18/20	250	0	100	150	CHF	103.80%	155'700.00	0.01	a)	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	750	0	0	750	CHF	110.10%	825'750.00	0.04	a)	
CH0237639502	1.2500 % GS 1 1/4 09/11/19 EMTN	1'100	0	100	1'000	CHF	103.00%	1'030'000.00	0.05	a)	
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	460	300	0	760	CHF	131.45%	999'020.00	0.05	a)	
CH0237650814	0.7500 % KBSCHW 0 3/4 03/12/20	900	0	100	800	CHF	102.75%	822'000.00	0.04	a)	
CH0238053091	1.0000 % BPLN 1 08/28/20	590	0	100	490	CHF	103.00%	504'700.00	0.02	a)	
CH0238053125	1.7500 % BPLN 1 3/4 02/28/24	1'070	0	0	1'070	CHF	109.00%	1'166'300.00	0.06	a)	
CH0238315656	1.5000 % BPCEGP 1 1/2 04/30/21 EMTN	0	400	0	400	CHF	105.70%	422'800.00	0.02	a)	
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	700	0	0	700	CHF	112.35%	786'450.00	0.04	a)	
CH0238315672	1.3750 % CCB 1 3/8 05/28/19 EMTN	800	0	100	700	CHF	102.60%	718'200.00	0.04	a)	
CH0238315680	2.0000 % FRSRJ 2 05/28/19	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0238315698	1.0000 % BSAAN 1 05/28/20	600	0	100	500	CHF	102.70%	513'500.00	0.03	a)	
CH0238339433	1.2500 % BNCHIL 1 1/4 03/21/19	700	0	100	600	CHF	102.35%	614'100.00	0.03	a)	
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	800	0	0	800	CHF	110.85%	886'800.00	0.04	a)	
CH0238841891	1.0000 % PSHYPO 1 01/14/22 590	2'000	0	500	1'500	CHF	105.22%	1'578'300.00	0.08	a)	
CH0239034314	0.8750 % KIWI 0 7/8 04/04/19	1'440	0	100	1'340	CHF	101.95%	1'366'130.00	0.07	a)	
CH0239193169	0.7500 % NDASS 0 3/4 10/04/19 EMTN	1'950	0	100	1'850	CHF	102.30%	1'892'550.00	0.09	a)	
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	400	400	0	800	CHF	109.25%	874'000.00	0.04	a)	
CH0239322495	1.1250 % RABOBK 1 1/8 04/08/21 EMTN	1'500	0	100	1'400	CHF	104.45%	1'462'300.00	0.07	a)	
CH0239498675	0.6250 % RY 0 5/8 04/09/19 EMTN	1'300	0	100	1'200	CHF	101.65%	1'219'800.00	0.06	a)	
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	800	700	0	1'500	CHF	108.50%	1'627'500.00	0.08	a)	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	1'800	0	0	1'800	CHF	109.22%	1'965'960.00	0.10	a)	
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	800	0	0	800	CHF	106.00%	848'000.00	0.04	a)	
CH0240330016	1.0000 % ZURCTY 1 04/25/22	300	0	0	300	CHF	105.40%	316'200.00	0.02	a)	
CH0240623741	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/21/18 446	1'200	0	100	1'100	CHF	100.82%	1'109'020.00	0.05	a)	
CH0240623758	0.8750 % PFZENT 0 7/8 06/10/21 447	2'500	0	100	2'400	CHF	104.37%	2'504'880.00	0.12	a)	
CH0240672193	0.7500 % SYNNVX 0 3/4 11/01/19	775	250	1'025	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	300	280	580	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0240907094	1.1250 % ABNAV 1 1/8 04/24/20 EMTN	400	0	100	300	CHF	103.40%	310'200.00	0.02	a)	
CH0241392783	1.2500 % ACAFP 1 1/4 07/17/20 EMTN	1'560	0	100	1'460	CHF	104.05%	1'519'130.00	0.07	a)	
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	2'650	0	0	2'650	CHF	108.55%	2'876'575.00	0.14	a)	
CH0241530960	1.0000 % LAUSAN 1 04/29/22	800	0	0	800	CHF	104.65%	837'200.00	0.04	a)	
CH0241634929	0.7500 % MET 0 3/4 04/17/19 EMTN	1'000	400	100	1'300	CHF	101.65%	1'321'450.00	0.06	a)	
CH0241926309	1.0000 % PSHYPO 1 05/10/22 592	2'250	0	0	2'250	CHF	105.42%	2'371'950.00	0.12	a)	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	650	1'300	0	1'950	CHF	110.64%	2'157'480.00	0.11	a)	
CH0242595277	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/06/20 448	2'100	0	100	2'000	CHF	102.34%	2'046'800.00	0.10	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe /	Verkufe /	Anzahl /		Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.
		Nominal in	Tsd.			Nominal in	Tsd.					
		01.02.2017		2)	3)	31.07.2017						
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449	2'000	0	0	0	2'000	CHF	106.52%	2'130'400.00	0.10	a)	
CH0242984067	1.6250 % MOBNSW 1 5/8 05/19/21	1'000	0	0	100	900	CHF	105.35%	948'150.00	0.05	a)	
CH0243017081	1.1250 % JPM 1 1/8 11/06/20 EMTN	1'000	0	0	100	900	CHF	103.75%	933'750.00	0.05	a)	
CH0243069256	1.1250 % BFCM 1 1/8 05/22/20 EMTN	1'400	0	0	100	1'300	CHF	103.65%	1'347'450.00	0.07	a)	
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	300	0	0	0	300	CHF	111.35%	334'050.00	0.02	a)	
CH0243069355	0.7500 % PM 0 3/4 12/16/19	250	0	0	100	150	CHF	102.60%	153'900.00	0.01	a)	
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	1'300	0	0	0	1'300	CHF	108.85%	1'415'050.00	0.07	a)	
CH0243154884	0.7500 % GRKPSW 0 3/4 05/07/21	1'100	0	0	100	1'000	CHF	103.40%	1'034'000.00	0.05	a)	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	800	0	0	0	800	CHF	107.30%	858'400.00	0.04	a)	
CH0243483812	0.5000 % NYLIFE 0 1/2 05/13/19 GMTN	1'500	0	0	100	1'400	CHF	101.35%	1'418'900.00	0.07	a)	
CH0243871735	1.0000 % VALIAN 1 11/22/19	400	0	0	100	300	CHF	102.60%	307'800.00	0.02	a)	
CH0244006414	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 10/05/21 594	800	0	0	100	700	CHF	104.47%	731'290.00	0.04	a)	
CH0244175201	1.2500 % KBFRI 1 1/4 06/03/24	400	0	0	0	400	CHF	107.55%	430'200.00	0.02	a)	
CH0244653520	0.8750 % COOPSW 0 7/8 06/16/21	1'100	0	0	100	1'000	CHF	103.10%	1'031'000.00	0.05	a)	
CH0244692528	1.2500 % OERLSW 1 1/4 06/17/19	1'100	0	0	100	1'000	CHF	102.10%	1'021'000.00	0.05	a)	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	1'200	0	0	0	1'200	CHF	113.80%	1'365'600.00	0.07	a)	
CH0244717978	1.5000 % AUCHAN 1 1/2 06/03/24 EMTN	800	0	0	0	800	CHF	106.30%	850'400.00	0.04	a)	
CH0244830441	1.2500 % MIVIVI 1 1/4 06/13/18	190	0	0	0	190	CHF	101.35%	192'565.00	0.01	a)	
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	500	0	0	0	500	CHF	111.25%	556'250.00	0.03	a)	
CH0245138950	1.6250 % BANCOG 1 5/8 06/18/18	370	0	0	100	270	CHF	101.00%	272'700.00	0.01	a)	
CH0245146185	1.0000 % KBAARG 1 06/19/23	1'750	0	0	0	1'750	CHF	105.70%	1'849'750.00	0.09	a)	
CH0245536799	0.6250 % EUROF 0 5/8 06/30/21	1'000	0	0	100	900	CHF	103.40%	930'600.00	0.05	a)	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	1'100	0	0	0	1'100	CHF	102.75%	1'130'250.00	0.06	a)	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'150	1'100	0	0	2'250	CHF	111.95%	2'518'875.00	0.12	a)	
CH0245865834	1.0000 % NAB 1 12/10/21 GMTN	1'250	0	0	100	1'150	CHF	104.35%	1'200'025.00	0.06	a)	
CH0245865842	1.7500 % ACFP 1 3/4 06/27/22 EMTN	600	0	0	0	600	CHF	106.85%	641'100.00	0.03	a)	
CH0245865883	0.6250 % WSTP 0 5/8 09/02/20 EMTN	1'190	0	0	100	1'090	CHF	102.35%	1'115'615.00	0.05	a)	
CH0246788183	1.1250 % BCICI 1 1/8 06/26/19	1'550	0	0	100	1'450	CHF	102.25%	1'482'625.00	0.07	a)	
CH0246921537	1.1250 % ADUHOL 1 1/8 07/16/21	1'250	0	0	100	1'150	CHF	104.00%	1'196'000.00	0.06	a)	
CH0247163618	1.0000 % OPBANK 1 07/14/21 EMTN	1'900	0	0	100	1'800	CHF	104.10%	1'873'800.00	0.09	a)	
CH0247611251	0.6250 % ZURNVX 0 5/8 07/22/20	1'850	0	0	100	1'750	CHF	102.20%	1'788'500.00	0.09	a)	
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	2'000	0	0	1'000	1'000	CHF	108.55%	1'085'500.00	0.05	a)	
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	1'300	0	0	0	1'300	CHF	113.35%	1'473'550.00	0.07	a)	
CH0247776138	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 07/14/26	1'400	0	0	0	1'400	CHF	109.70%	1'535'800.00	0.07	a)	
CH0247849992	1.0000 % PSHYPO 1 03/21/23 595	3'200	0	0	0	3'200	CHF	105.82%	3'386'240.00	0.17	a)	
CH0247902890	1.0000 % TOTAL 1 08/29/24 EMTN	2'550	0	0	0	2'550	CHF	104.65%	2'668'575.00	0.13	a)	
CH0247902908	0.6250 % WFC 0 5/8 09/03/20 EMTN	700	600	0	100	1'200	CHF	102.25%	1'227'000.00	0.06	a)	
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	900	0	0	0	900	CHF	106.35%	957'150.00	0.05	a)	
CH0247904557	1.0000 % POLAND 1 09/17/21 EMTN	1'975	0	0	100	1'875	CHF	104.40%	1'957'500.00	0.10	a)	
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	700	400	0	0	1'100	CHF	106.40%	1'170'400.00	0.06	a)	
CH0248204627	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/15/19 451	1'360	0	0	100	1'260	CHF	101.42%	1'277'892.00	0.06	a)	
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	990	0	0	0	990	CHF	106.18%	1'051'182.00	0.05	a)	
CH0248259456	0.7500 % CS 0 3/4 07/11/19	3'100	0	0	300	2'800	CHF	101.75%	2'849'000.00	0.14	a)	
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	1'400	0	0	0	1'400	CHF	103.50%	1'449'000.00	0.07	a)	
CH0248890573	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 08/21/19	1'380	0	0	100	1'280	CHF	101.35%	1'297'280.00	0.06	a)	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	2'800	600	0	0	3'400	CHF	106.33%	3'615'220.00	0.18	a)	
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	2'500	0	0	800	1'700	CHF	105.45%	1'792'650.00	0.09	a)	
CH0251429384	0.6250 % TESSIN 0 5/8 05/09/22	450	0	0	0	450	CHF	103.60%	466'200.00	0.02	a)	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	500	0	0	0	500	CHF	105.55%	527'750.00	0.03	a)	
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	1'350	0	0	0	1'350	CHF	109.10%	1'472'850.00	0.07	a)	
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'400	0	0	0	1'400	CHF	110.45%	1'546'300.00	0.08	a)	
CH0252511925	0.8750 % LANSBK 0 7/8 09/16/24 EMTN	270	0	0	0	270	CHF	105.55%	284'985.00	0.01	a)	
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	2'880	0	0	0	2'880	CHF	99.90%	2'877'120.00	0.14	a)	
CH0252740250	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 09/09/22	2'400	0	0	0	2'400	CHF	103.25%	2'478'000.00	0.12	a)	
CH0252903684	0.5000 % KTBL 0 1/2 03/30/22	1'250	500	0	0	1'750	CHF	104.00%	1'820'000.00	0.09	a)	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	1'400	0	0	0	1'400	CHF	107.50%	1'505'000.00	0.07	a)	
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	1'700	500	0	0	2'200	CHF	112.95%	2'484'900.00	0.12	a)	
CH0253225921	0.5000 % EBN 0 1/2 09/22/22	825	0	0	0	825	CHF	102.95%	849'337.50	0.04	a)	
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	500	0	0	0	500	CHF	105.20%	526'000.00	0.03	a)	
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	500	0	0	0	500	CHF	105.30%	526'500.00	0.03	a)	
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	800	0	0	0	800	CHF	108.70%	869'600.00	0.04	a)	
CH0253514753	0.6250 % BATSLN 0 5/8 09/08/21 EMTN	2'010	0	0	100	1'910	CHF	102.05%	1'949'155.00	0.10	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe / Zugange 2)	Verkufe / Abgange 3)	Anzahl /		Wah- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		Nominal in Tsd.	Nominal in Tsd.									
		01.02.2017	31.07.2017									
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	1'100	0	0	1'100	CHF	106.50%	1'171'500.00	0.06	a)		
CH0253592734	1.3750 % CRHID 1 3/8 09/30/22	1'400	0	0	1'400	CHF	105.05%	1'470'700.00	0.07	a)		
CH0253592767	1.6250 % IMPNSW 1 5/8 10/15/24	800	0	0	800	CHF	106.60%	852'800.00	0.04	a)		
CH0253609082	0.1250 % PFZENT 0 1/8 05/15/19 453	3'000	0	100	2'900	CHF	101.09%	2'931'610.00	0.14	a)		
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	1'450	0	0	1'450	CHF	104.50%	1'515'250.00	0.07	a)		
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	600	0	0	600	CHF	106.35%	638'100.00	0.03	a)		
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	650	0	0	650	CHF	109.35%	710'775.00	0.03	a)		
CH0253613530	0.6250 % BUCNSW 0 5/8 10/02/20	500	0	100	400	CHF	101.25%	405'000.00	0.02	a)		
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	500	0	0	500	CHF	103.75%	518'750.00	0.03	a)		
CH0254147504	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 09/28/29	500	0	0	500	CHF	109.80%	549'000.00	0.03	a)		
CH0254212225	0.3750 % ZURICH 0 3/8 10/06/21	500	0	100	400	CHF	102.70%	410'800.00	0.02	a)		
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	600	0	0	600	CHF	107.80%	646'800.00	0.03	a)		
CH0254281634	1.0000 % ICBCAS 1 12/17/19	600	0	100	500	CHF	102.45%	512'250.00	0.02	a)		
CH0254281642	0.7500 % KORESC 0 3/4 11/12/19	700	0	100	600	CHF	101.45%	608'700.00	0.03	a)		
CH0254281659	0.5000 % CABEI 0 1/2 11/26/18	900	0	0	900	CHF	101.23%	911'070.00	0.04	a)		
CH0254282202	1.0000 % MET 1 09/19/22 0000	2'000	0	0	2'000	CHF	104.95%	2'099'000.00	0.10	a)		
CH0254284778	1.0000 % COOPSW 1 09/29/23	500	500	0	1'000	CHF	104.15%	1'041'500.00	0.05	a)		
CH0254849513	0.6250 % ZUGKAN 0 5/8 10/17/22	300	0	0	300	CHF	103.45%	310'350.00	0.02	a)		
CH0254859116	1.0000 % CS 1 09/24/21 EMTN	3'570	0	1'100	2'470	CHF	103.55%	2'557'685.00	0.12	a)		
CH0255286707	0.7500 % BPLN 0 3/4 09/27/21 EMTN	1'700	0	100	1'600	CHF	102.85%	1'645'600.00	0.08	a)		
CH0255287010	0.7500 % CMBNSW 0 3/4 10/14/19	900	0	100	800	CHF	102.10%	816'800.00	0.04	a)		
CH0255287028	1.2500 % CMBNSW 1 1/4 10/14/22	1'400	0	0	1'400	CHF	105.40%	1'475'600.00	0.07	a)		
CH0255475284	0.5000 % LISNSW 0 1/2 10/08/20	500	350	100	750	CHF	101.85%	763'875.00	0.04	a)		
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	1'015	0	0	1'015	CHF	105.80%	1'073'870.00	0.05	a)		
CH0255590801	1.0000 % ACAFP 1 10/08/21 EMTN	1'350	0	100	1'250	CHF	104.00%	1'300'000.00	0.06	a)		
CH0255678325	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/02/21 597	1'300	0	600	700	CHF	102.37%	716'590.00	0.03	a)		
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	1'550	0	0	1'550	CHF	106.37%	1'648'735.00	0.08	a)		
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	1'000	0	0	1'000	CHF	110.93%	1'109'300.00	0.05	a)		
CH0255893049	1.2500 % GLENLN 1 1/4 12/01/20 EMTN	1'900	0	100	1'800	CHF	103.15%	1'856'700.00	0.09	a)		
CH0255893056	1.1250 % CABEI 1 1/8 02/24/23	150	0	0	150	CHF	105.35%	158'025.00	0.01	a)		
CH0255893064	0.5000 % WSTP 0 1/2 02/02/22 GMTN	1'730	0	0	1'730	CHF	102.20%	1'768'060.00	0.09	a)		
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	1'250	0	0	1'250	CHF	101.65%	1'270'625.00	0.06	a)		
CH0255893114	0.7500 % HELNSW 0 3/4 10/28/20	1'745	0	100	1'645	CHF	102.40%	1'684'480.00	0.08	a)		
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	700	0	0	700	CHF	107.40%	751'800.00	0.04	a)		
CH0255896190	0.3750 % THURBK 0 3/8 10/23/20	1'100	0	100	1'000	CHF	102.00%	1'020'000.00	0.05	a)		
CH0256434595	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/21/20 455	2'690	0	100	2'590	CHF	101.65%	2'632'735.00	0.13	a)		
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	3'300	0	0	3'300	CHF	104.75%	3'456'750.00	0.17	a)		
CH0256886505	0.3750 % NIEDOE 0 3/8 04/27/21	0	500	0	500	CHF	102.15%	510'750.00	0.02	a)		
CH0257042165	1.0000 % SPSNSW 1 12/10/19	200	0	100	100	CHF	102.65%	102'650.00	0.01	a)		
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	500	0	0	500	CHF	108.85%	544'250.00	0.03	a)		
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	700	0	0	700	CHF	104.15%	729'050.00	0.04	a)		
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	1'100	700	0	1'800	CHF	104.80%	1'886'400.00	0.09	a)		
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	4'100	0	0	4'100	CHF	104.59%	4'288'190.00	0.21	a)		
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	470	0	0	470	CHF	113.82%	534'954.00	0.03	a)		
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	1'810	0	0	1'810	CHF	109.13%	1'975'253.00	0.10	a)		
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	900	0	0	900	CHF	109.40%	984'600.00	0.05	a)		
CH0260296618	0.8750 % BCICI 0 7/8 11/23/18	400	0	100	300	CHF	101.03%	303'090.00	0.01	a)		
CH0260496283	0.8750 % NONGNO 0 7/8 12/02/20 EMTN	1'350	0	100	1'250	CHF	102.95%	1'286'875.00	0.06	a)		
CH0260515751	0.3750 % SOLEUR 0 3/8 12/15/21	300	0	100	200	CHF	102.65%	205'300.00	0.01	a)		
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	760	0	0	760	CHF	104.60%	794'960.00	0.04	a)		
CH0260769382	0.5000 % T 0 1/2 12/04/19	1'800	0	100	1'700	CHF	101.20%	1'720'400.00	0.08	a)		
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	3'150	500	0	3'650	CHF	104.50%	3'814'250.00	0.19	a)		
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	400	0	0	400	CHF	108.45%	433'800.00	0.02	a)		
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	350	0	0	350	CHF	104.60%	366'100.00	0.02	a)		
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	900	0	0	900	CHF	105.30%	947'700.00	0.05	a)		
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	700	0	0	700	CHF	103.75%	726'250.00	0.04	a)		
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	1'725	0	0	1'725	CHF	115.52%	1'992'720.00	0.10	a)		
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	2'300	0	0	2'300	CHF	103.55%	2'381'650.00	0.12	a)		
CH0262286237	0.3750 % WKBNSW 0 3/8 12/15/21	2'800	0	100	2'700	CHF	101.60%	2'743'200.00	0.13	a)		
CH0262286252	0.6250 % WKBNSW 0 5/8 12/15/23	250	0	0	250	CHF	103.10%	257'750.00	0.01	a)		
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	1'500	0	0	1'500	CHF	102.50%	1'537'500.00	0.08	a)		
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	1'450	0	500	950	CHF	104.60%	993'700.00	0.05	a)		

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe /	Verkufe /	Anzahl /		Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.
		Nominal in	Tsd.			Nominal in	Tsd.					
		01.02.2017		2)	3)	31.07.2017						
CH0262883363	0.6250 % ACAFP 0 5/8 09/15/23 EMTN	1'700	0	0	0	1'700	CHF	102.15%	1'736'550.00	0.08	a)	
CH0262888933	0.5000 % VBPSW 0 1/2 04/07/21	350	0	0	100	250	CHF	101.80%	254'500.00	0.01	a)	
CH0262888941	0.8750 % VBPSW 0 7/8 10/07/24	350	0	0	0	350	CHF	103.65%	362'775.00	0.02	a)	
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	3'400	0	0	0	3'400	CHF	103.00%	3'502'000.00	0.17	a)	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	2'950	0	0	0	2'950	CHF	106.54%	3'142'930.00	0.15	a)	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	4'800	0	0	0	4'800	CHF	103.60%	4'972'800.00	0.24	a)	
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	1'950	0	0	0	1'950	CHF	102.75%	2'003'625.00	0.10	a)	
CH0266153656	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 01/28/21	900	0	0	100	800	CHF	101.50%	812'000.00	0.04	a)	
CH0266437950	0.3750 % KBLUZE 0 3/8 01/30/23	4'300	0	0	0	4'300	CHF	102.00%	4'386'000.00	0.21	a)	
CH0266836128	0.1250 % ENGAKR 0 1/8 03/02/22	200	0	0	0	200	CHF	98.60%	197'200.00	0.01	a)	
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	400	0	0	0	400	CHF	100.05%	400'200.00	0.02	a)	
CH0266842696	0.3750 % ACAFP 0 3/8 01/27/20 EMTN	150	0	0	0	150	CHF	101.30%	151'950.00	0.01	a)	
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	1'000	0	0	0	1'000	CHF	104.20%	1'042'000.00	0.05	a)	
CH0267020045	0.3750 % NYLIFE 0 3/8 02/02/22 GDIF	1'800	300	0	0	2'100	CHF	101.95%	2'140'950.00	0.10	a)	
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	4'950	0	0	0	4'950	CHF	98.38%	4'869'810.00	0.24	a)	
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	900	0	0	0	900	CHF	99.75%	897'750.00	0.04	a)	
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	350	0	0	0	350	CHF	100.15%	350'525.00	0.02	a)	
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	350	0	0	0	350	CHF	99.50%	348'250.00	0.02	a)	
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	550	0	0	0	550	CHF	98.45%	541'475.00	0.03	a)	
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	6'450	0	0	1'000	5'450	CHF	101.39%	5'525'755.00	0.27	a)	
CH0268988174	0.2500 % SCMN VX 0 1/4 04/17/23	2'700	0	0	0	2'700	CHF	100.95%	2'725'650.00	0.13	a)	
CH0268988182	1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35	650	0	0	0	650	CHF	101.65%	660'725.00	0.03	a)	
CH0269382088	0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30	2'700	0	0	0	2'700	CHF	98.70%	2'664'900.00	0.13	a)	
CH0269697931	0.3750 % KB SH 0 3/8 02/16/27	1'000	0	0	0	1'000	CHF	99.75%	997'500.00	0.05	a)	
CH0269699176	0.3750 % GLRN KB 0 3/8 02/26/27	700	0	0	0	700	CHF	99.35%	695'450.00	0.03	a)	
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	350	0	0	0	350	CHF	99.00%	346'500.00	0.02	a)	
CH0269836703	0.6250 % MQGAU 0 5/8 09/04/23 EMTN	1'845	0	0	0	1'845	CHF	101.90%	1'880'055.00	0.09	a)	
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	700	0	0	0	700	CHF	98.60%	690'200.00	0.03	a)	
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	1'450	0	0	0	1'450	CHF	100.35%	1'455'075.00	0.07	a)	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	1'150	0	0	0	1'150	CHF	100.15%	1'151'725.00	0.06	a)	
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	1'700	0	0	0	1'700	CHF	102.75%	1'746'750.00	0.09	a)	
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	250	0	0	0	250	CHF	107.30%	268'250.00	0.01	a)	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	900	0	0	0	900	CHF	100.60%	905'400.00	0.04	a)	
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	1'300	0	0	0	1'300	CHF	99.90%	1'298'700.00	0.06	a)	
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	5'400	0	0	0	5'400	CHF	101.90%	5'502'600.00	0.27	a)	
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	1'800	0	0	0	1'800	CHF	101.55%	1'827'900.00	0.09	a)	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	2'950	800	0	0	3'750	CHF	100.81%	3'780'375.00	0.18	a)	
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	2'400	0	0	0	2'400	CHF	103.14%	2'475'360.00	0.12	a)	
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	400	0	0	0	400	CHF	102.60%	410'400.00	0.02	a)	
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	800	0	0	0	800	CHF	100.90%	807'200.00	0.04	a)	
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	3'560	0	0	0	3'560	CHF	101.50%	3'613'400.00	0.18	a)	
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'400	0	0	0	1'400	CHF	107.10%	1'499'400.00	0.07	a)	
CH0273037892	0.2500 % WKBNSW 0 1/4 03/16/23	1'650	0	0	750	900	CHF	101.10%	909'900.00	0.04	a)	
CH0273347820	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 03/31/21	250	0	0	100	150	CHF	101.95%	152'925.00	0.01	a)	
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	850	0	0	0	850	CHF	105.45%	896'325.00	0.04	a)	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	600	0	0	0	600	CHF	101.80%	610'800.00	0.03	a)	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	1'550	0	0	0	1'550	CHF	101.81%	1'578'055.00	0.08	a)	
CH0273755824	0.2300 % SWAUTO 0.23 03/25/19	1'200	0	0	100	1'100	CHF	100.65%	1'107'150.00	0.05	a)	
CH0273761350	0.1500 % WINCTY 0.15 03/27/23	400	0	0	0	400	CHF	100.75%	403'000.00	0.02	a)	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'150	0	0	0	2'150	CHF	99.80%	2'145'700.00	0.10	a)	
CH0274253514	0.6000 % KBFRIB 0.6 04/09/27	700	0	0	0	700	CHF	101.95%	713'650.00	0.03	a)	
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	900	0	0	0	900	CHF	102.95%	926'550.00	0.05	a)	
CH0274740262	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/31/21 134	1'150	0	0	100	1'050	CHF	101.50%	1'065'750.00	0.05	a)	
CH0274758827	0.6250 % MDLZ 0 5/8 12/30/21	1'500	0	0	200	1'300	CHF	102.05%	1'326'650.00	0.06	a)	
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	1'250	0	0	0	1'250	CHF	102.90%	1'286'250.00	0.06	a)	
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	750	0	0	0	750	CHF	101.35%	760'125.00	0.04	a)	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	500	0	0	0	500	CHF	101.60%	508'000.00	0.02	a)	
CH0275776430	1.1250 % ISHZ 1 1/8 04/17/23	0	300	0	0	300	CHF	103.65%	310'950.00	0.02	a)	
CH0276237648	0.0500 % GEBNVX 0.05 04/17/19	400	0	0	100	300	CHF	100.45%	301'350.00	0.01	a)	
CH0276237663	0.3000 % GEBNVX 0.3 04/17/23	700	0	0	0	700	CHF	100.95%	706'650.00	0.03	a)	
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	1'350	0	0	0	1'350	CHF	100.85%	1'361'475.00	0.07	a)	
CH0276581110	0.1940 % CABEI 0.194 11/19/21 EMTN	600	0	0	100	500	CHF	100.95%	504'750.00	0.02	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0276801450	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 01/25/19 607	500	0	200	300	CHF	100.99%	302'970.00	0.01	a)	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	2'250	0	0	2'250	CHF	99.84%	2'246'400.00	0.11	a)	
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	4'750	0	500	4'250	CHF	102.80%	4'369'000.00	0.21	a)	
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	930	0	0	930	CHF	100.95%	938'835.00	0.05	a)	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	1'000	0	0	1'000	CHF	100.45%	1'004'500.00	0.05	a)	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	1'600	0	0	1'600	CHF	99.84%	1'597'440.00	0.08	a)	
CH0278875940	0.6250 % FABUH 0 5/8 05/27/22	400	0	0	400	CHF	101.55%	406'200.00	0.02	a)	
CH0278875965	0.2500 % BCICI 0 1/4 06/17/20	1'000	0	100	900	CHF	100.35%	903'150.00	0.04	a)	
CH0278875973	0.3750 % WFC 0 3/8 06/02/22 EMTN	1'470	0	0	1'470	CHF	101.50%	1'492'050.00	0.07	a)	
CH0279135310	0.2500 % SGSNVX 0 1/4 05/08/23	1'400	0	0	1'400	CHF	100.70%	1'409'800.00	0.07	a)	
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	1'650	0	0	1'650	CHF	101.10%	1'668'150.00	0.08	a)	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	450	0	0	450	CHF	100.35%	451'575.00	0.02	a)	
CH0279929712	0.1500 % KBAARG 0.15 05/18/22	1'450	0	0	1'450	CHF	101.00%	1'464'500.00	0.07	a)	
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	950	0	0	950	CHF	103.85%	986'575.00	0.05	a)	
CH0280567469	0.3750 % BSANCI 0 3/8 05/19/22	1'400	0	0	1'400	CHF	100.65%	1'409'100.00	0.07	a)	
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	550	0	0	550	CHF	100.61%	553'355.00	0.03	a)	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	2'250	0	0	2'250	CHF	99.61%	2'241'225.00	0.11	a)	
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	700	0	0	700	CHF	100.40%	702'800.00	0.03	a)	
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	1'150	0	0	1'150	CHF	99.30%	1'141'950.00	0.06	a)	
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	700	0	0	700	CHF	102.30%	716'100.00	0.03	a)	
CH0281864493	1.6250 % BSTDBK 1 5/8 12/20/19	600	0	100	500	CHF	102.90%	514'500.00	0.03	a)	
CH0282018974	0.7600 % SINOCH 0.76 06/17/22 EMTN	1'100	0	0	1'100	CHF	101.60%	1'117'600.00	0.05	a)	
CH0282018982	0.5000 % TOTAL 0 1/2 06/01/27 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.80%	998'000.00	0.05	a)	
CH0282018990	0.2500 % BZLNZ 0 1/4 06/24/22 GMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	100.85%	2'017'000.00	0.10	a)	
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	550	0	0	550	CHF	105.20%	578'600.00	0.03	a)	
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	750	0	0	750	CHF	101.35%	760'125.00	0.04	a)	
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	750	0	0	750	CHF	101.90%	764'250.00	0.04	a)	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	2'550	0	0	2'550	CHF	102.79%	2'621'145.00	0.13	a)	
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	1'800	0	0	1'800	CHF	104.84%	1'887'120.00	0.09	a)	
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	550	0	0	550	CHF	101.70%	559'350.00	0.03	a)	
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	750	0	0	750	CHF	103.20%	774'000.00	0.04	a)	
CH0282857892	0.1800 % SCARD 0.18 06/15/18 A	825	0	100	725	CHF	100.45%	728'262.50	0.04	a)	
CH0282857926	0.3400 % SCARD 0.34 06/15/20 A	700	0	100	600	CHF	101.00%	606'000.00	0.03	a)	
CH0283726088	0.5750 % DVB 0.575 06/17/22 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.10%	1'001'000.00	0.05	a)	
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	550	0	0	550	CHF	102.00%	561'000.00	0.03	a)	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	1'800	0	0	1'800	CHF	102.25%	1'840'500.00	0.09	a)	
CH0284415681	0.5500 % NDASS 0.55 06/23/25 EMTN	1'850	0	0	1'850	CHF	101.75%	1'882'375.00	0.09	a)	
CH0284607394	1.0000 % HIAGSW 1 07/01/21	500	0	100	400	CHF	102.15%	408'600.00	0.02	a)	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	2'300	0	0	2'300	CHF	102.60%	2'359'800.00	0.12	a)	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	1'900	600	0	2'500	CHF	105.30%	2'632'500.00	0.13	a)	
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	1'500	0	0	1'500	CHF	108.00%	1'620'000.00	0.08	a)	
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	300	0	0	300	CHF	103.05%	309'150.00	0.02	a)	
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	1'100	0	0	1'100	CHF	107.15%	1'178'650.00	0.06	a)	
CH0285509334	2.1250 % ALPHSW 2 1/8 06/30/23	550	0	0	550	CHF	102.75%	565'125.00	0.03	a)	
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMT	1'100	0	0	1'100	CHF	104.05%	1'144'550.00	0.06	a)	
CH0285849359	0.3750 % PFZENT 0 3/8 08/30/23 465	3'200	0	0	3'200	CHF	102.25%	3'272'000.00	0.16	a)	
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	1'100	0	0	1'100	CHF	102.84%	1'131'240.00	0.06	a)	
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	1'000	0	0	1'000	CHF	104.05%	1'040'500.00	0.05	a)	
CH0287817842	0.2500 % COOPSW 0 1/4 07/31/20	2'000	0	100	1'900	CHF	100.90%	1'917'100.00	0.09	a)	
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	1'000	0	0	1'000	CHF	103.25%	1'032'500.00	0.05	a)	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	500	0	0	500	CHF	102.44%	512'200.00	0.02	a)	
CH0289316397	0.3500 % NAB 0.35 08/05/22 GMTN	1'930	0	0	1'930	CHF	101.45%	1'957'985.00	0.10	a)	
CH0290007134	0.3750 % KBBS 0 3/8 08/10/23	1'300	0	0	1'300	CHF	101.95%	1'325'350.00	0.06	a)	
CH0290876496	0.5000 % KWLLILI 0 1/2 09/09/21	800	0	100	700	CHF	99.45%	696'150.00	0.03	a)	
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	4'800	900	1'000	4'700	CHF	101.30%	4'761'100.00	0.23	a)	
CH0292086193	0.4500 % CAF 0.45 09/07/23 EMTN	1'250	0	0	1'250	CHF	101.60%	1'270'000.00	0.06	a)	
CH0292086714	0.5500 % ACAFP 0.55 09/01/22 EMTN	500	0	0	500	CHF	102.00%	510'000.00	0.02	a)	
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	300	0	0	300	CHF	101.00%	303'000.00	0.01	a)	
CH0292774657	0.6250 % CS 0 5/8 08/21/20 EMTN	2'400	0	100	2'300	CHF	101.40%	2'332'200.00	0.11	a)	
CH0292877880	0.3750 % RDSALN 0 3/8 08/21/23 EMTN	3'750	0	0	3'750	CHF	101.20%	3'795'000.00	0.19	a)	
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	3'750	0	0	3'750	CHF	103.60%	3'885'000.00	0.19	a)	
CH0292984447	0.5000 % SANSCF 0 1/2 10/05/20 EMTN	750	0	100	650	CHF	101.00%	656'500.00	0.03	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	300	0	0	300	CHF	107.60%	322'800.00	0.02	a)	
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	700	400	0	1'100	CHF	100.55%	1'106'050.00	0.05	a)	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	1'400	0	0	1'400	CHF	100.70%	1'409'800.00	0.07	a)	
CH0293173446	0.6250 % LONNVX 0 5/8 09/22/20	500	0	100	400	CHF	101.15%	404'600.00	0.02	a)	
CH0293173453	1.2500 % LONNVX 1 1/4 09/22/23	500	0	0	500	CHF	103.30%	516'500.00	0.03	a)	
CH0293343395	0.0800 % WKBNSW 0.08 09/15/21	750	0	100	650	CHF	100.45%	652'925.00	0.03	a)	
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	500	0	0	500	CHF	100.30%	501'500.00	0.02	a)	
CH0295050915	0.5000 % CMBNSW 0 1/2 09/15/21	500	0	100	400	CHF	101.75%	407'000.00	0.02	a)	
CH0295186370	0.0000 % PFZENT 0 07/15/20 468	2'900	0	100	2'800	CHF	101.08%	2'830'240.00	0.14	a)	
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	1'500	0	0	1'500	CHF	101.41%	1'521'150.00	0.07	a)	
CH0295653577	0.3000 % BNS 0.3 09/16/22 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	101.10%	1'617'600.00	0.08	a)	
CH0296231951	0.3500 % NIEDOE 0.35 09/22/23	2'180	0	0	2'180	CHF	101.70%	2'217'060.00	0.11	a)	
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	3'200	0	0	3'200	CHF	101.30%	3'241'600.00	0.16	a)	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	700	0	0	700	CHF	104.84%	733'880.00	0.04	a)	
CH0297343557	0.0000 % SOLEUR 0 10/16/23	500	0	0	500	CHF	100.40%	502'000.00	0.02	a)	
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	900	0	0	900	CHF	100.70%	906'300.00	0.04	a)	
CH0297782879	0.6250 % MDLZ 0 5/8 10/06/20	600	0	100	500	CHF	101.95%	509'750.00	0.02	a)	
CH0297974880	0.2500 % KO 0 1/4 12/22/22	2'000	0	0	2'000	CHF	101.05%	2'021'000.00	0.10	a)	
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	2'350	0	0	2'350	CHF	105.40%	2'476'900.00	0.12	a)	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	500	0	0	500	CHF	101.65%	508'250.00	0.02	a)	
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	1'950	0	0	1'950	CHF	101.65%	1'982'175.00	0.10	a)	
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	900	0	0	900	CHF	101.85%	916'650.00	0.04	a)	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	1'500	0	500	1'000	CHF	99.95%	999'500.00	0.05	a)	
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	2'150	0	0	2'150	CHF	100.29%	2'156'235.00	0.11	a)	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	4'050	0	0	4'050	CHF	101.15%	4'096'575.00	0.20	a)	
CH0301549348	0.2500 % STAACA 0 1/4 11/17/25 EMTN	500	400	0	900	CHF	100.75%	906'750.00	0.04	a)	
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	3'050	0	0	3'050	CHF	100.18%	3'055'490.00	0.15	a)	
CH0302790115	0.2500 % NDASS 0 1/4 11/27/23 EMTN	3'950	0	0	3'950	CHF	100.70%	3'977'650.00	0.19	a)	
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	200	0	0	200	CHF	99.40%	198'800.00	0.01	a)	
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	700	0	0	700	CHF	100.45%	703'150.00	0.03	a)	
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'300	0	0	1'300	CHF	99.75%	1'296'750.00	0.06	a)	
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN	1'110	0	0	1'110	CHF	101.60%	1'127'760.00	0.06	a)	
CH0304055806	0.2000 % SWICAR 0.2 11/19/18	1'100	0	100	1'000	CHF	100.48%	1'004'800.00	0.05	a)	
CH0304749218	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 12/16/22	700	0	0	700	CHF	101.50%	710'500.00	0.03	a)	
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	2'100	0	0	2'100	CHF	101.32%	2'127'720.00	0.10	a)	
CH0304966960	0.0500 % KBAARG 0.05 12/16/22	700	0	0	700	CHF	100.20%	701'400.00	0.03	a)	
CH0305117886	1.5000 % PEMEX 1 1/2 12/08/20 EMTN	2'250	0	100	2'150	CHF	102.20%	2'197'300.00	0.11	a)	
CH0305186535	0.0400 % ZKB 0.04 12/09/22 136	1'000	0	0	1'000	CHF	100.20%	1'002'000.00	0.05	a)	
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.80%	998'000.00	0.05	a)	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	700	0	0	700	CHF	99.60%	697'200.00	0.03	a)	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	2'960	0	0	2'960	CHF	101.50%	3'004'400.00	0.15	a)	
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	1'600	0	0	1'600	CHF	104.05%	1'664'800.00	0.08	a)	
CH0306173722	0.0000 % PFZENT 0 07/25/23 472	5'000	0	0	5'000	CHF	99.93%	4'996'500.00	0.24	a)	
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	850	0	0	850	CHF	99.03%	841'755.00	0.04	a)	
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	1'850	0	0	1'850	CHF	99.56%	1'841'860.00	0.09	a)	
CH0306179091	0.3750 % LHNVDX 0 3/8 12/03/21	2'000	0	100	1'900	CHF	100.65%	1'912'350.00	0.09	a)	
CH0306179125	1.0000 % LHNVDX 1 12/04/25	600	0	0	600	CHF	102.60%	615'600.00	0.03	a)	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	700	0	0	700	CHF	103.10%	721'700.00	0.04	a)	
CH0306770600	0.3750 % WSTP 0 3/8 02/05/24 EMTN	700	0	0	700	CHF	100.65%	704'550.00	0.03	a)	
CH0307256401	0.0300 % ZKB 0.03 02/11/22 137	1'000	0	0	1'000	CHF	100.50%	1'005'000.00	0.05	a)	
CH0307256419	0.0000 % SCHWYZ 0 01/20/23	2'850	0	1'500	1'350	CHF	100.80%	1'360'800.00	0.07	a)	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'400	0	0	2'400	CHF	98.45%	2'362'800.00	0.12	a)	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	700	0	0	700	CHF	101.20%	708'400.00	0.03	a)	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	1'800	0	0	1'800	CHF	98.34%	1'770'120.00	0.09	a)	
CH0309761853	0.2500 % NAB 0 1/4 01/19/23 GMTN	800	0	0	800	CHF	100.60%	804'800.00	0.04	a)	
CH0310175507	0.0000 % KTBS 0 01/28/22	700	0	200	500	CHF	101.10%	505'500.00	0.02	a)	
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	102.70%	1'027'000.00	0.05	a)	
CH0310175549	0.6500 % MDLZ 0.65 07/26/22	2'100	0	0	2'100	CHF	102.20%	2'146'200.00	0.10	a)	
CH0310175556	0.0000 % PSHYPO 0 01/09/20 624	300	0	100	200	CHF	101.00%	202'000.00	0.01	a)	
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	2'200	1'100	0	3'300	CHF	99.75%	3'291'750.00	0.16	a)	
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	700	0	0	700	CHF	99.05%	693'350.00	0.03	a)	
CH0310451825	0.2500 % ANZNX 0 1/4 10/25/23 EMTN	700	0	0	700	CHF	100.15%	701'050.00	0.03	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0310451833	0.1500 % CAF 0.15 02/24/22 EMTN	550	0	0	550	CHF	100.50%	552'750.00	0.03	a)	
CH0310451841	0.7500 % UBS 0 3/4 02/22/22	2'000	0	0	2'000	CHF	102.70%	2'054'000.00	0.10	a)	
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	800	800	600	1'000	CHF	103.50%	1'035'000.00	0.05	a)	
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	700	0	0	700	CHF	100.15%	701'050.00	0.03	a)	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	3'380	0	0	3'380	CHF	100.90%	3'410'420.00	0.17	a)	
CH0311427618	0.2000 % WKBNSW 0.2 08/19/24	500	0	0	500	CHF	100.10%	500'500.00	0.02	a)	
CH0311427626	0.3710 % CABEI 0.371 08/26/22 EMTN	1'960	0	0	1'960	CHF	101.30%	1'985'480.00	0.10	a)	
CH0311427675	0.5500 % GS 0.55 09/09/21 EMTN	1'470	0	100	1'370	CHF	102.05%	1'398'085.00	0.07	a)	
CH0312203851	0.0000 % KBBL 0 04/20/20	600	0	100	500	CHF	100.75%	503'750.00	0.02	a)	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	600	0	0	600	CHF	97.55%	585'300.00	0.03	a)	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	1'700	0	0	1'700	CHF	100.70%	1'711'900.00	0.08	a)	
CH0312512699	0.0000 % PFZENT 0 12/15/21 477	1'800	0	200	1'600	CHF	100.76%	1'612'160.00	0.08	a)	
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	2'450	0	0	2'450	CHF	97.51%	2'388'995.00	0.12	a)	
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	1'250	0	0	1'250	CHF	100.20%	1'252'500.00	0.06	a)	
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	900	0	0	900	CHF	94.50%	850'500.00	0.04	a)	
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	500	0	0	500	CHF	99.50%	497'500.00	0.02	a)	
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	4'720	0	0	4'720	CHF	101.50%	4'790'800.00	0.23	a)	
CH0314250983	0.0000 % KBAARG 0 03/08/22	350	0	0	350	CHF	100.30%	351'050.00	0.02	a)	
CH0315593860	0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN	1'220	0	0	1'220	CHF	99.35%	1'212'070.00	0.06	a)	
CH0315593910	0.5500 % BANQUE 0.55 10/11/22 EMTN	980	0	0	980	CHF	101.15%	991'270.00	0.05	a)	
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	1'350	1'000	0	2'350	CHF	94.35%	2'217'225.00	0.11	a)	
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	350	0	0	350	CHF	99.70%	348'950.00	0.02	a)	
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	350	0	0	350	CHF	99.55%	348'425.00	0.02	a)	
CH0316423265	0.3000 % NONGNO 0.3 09/16/22 EMTN	830	0	0	830	CHF	100.45%	833'735.00	0.04	a)	
CH0316994638	0.6000 % SANSFC 0.6 03/23/21 EMTN	350	0	100	250	CHF	101.45%	253'625.00	0.01	a)	
CH0316994661	1.0000 % IMPNSW 1 03/20/26	650	0	0	650	CHF	101.30%	658'450.00	0.03	a)	
CH0317921663	0.3750 % SCMNFX 0 3/8 03/31/28	500	0	0	500	CHF	98.85%	494'250.00	0.02	a)	
CH0318407761	0.3500 % MINGNO 0.35 04/05/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	100.25%	501'250.00	0.02	a)	
CH0319403702	1.5000 % KWLILI 1 1/2 12/06/22	900	0	0	900	CHF	102.80%	925'200.00	0.05	a)	
CH0319403736	0.0000 % PFZENT 0 11/07/22 479	1'200	0	0	1'200	CHF	100.32%	1'203'840.00	0.06	a)	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	3'550	0	0	3'550	CHF	97.72%	3'469'060.00	0.17	a)	
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	1'100	0	0	1'100	CHF	98.35%	1'081'850.00	0.05	a)	
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	350	0	0	350	CHF	99.55%	348'425.00	0.02	a)	
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	1'150	0	0	1'150	CHF	99.20%	1'140'800.00	0.06	a)	
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	2'950	1'300	1'000	3'250	CHF	96.79%	3'145'675.00	0.15	a)	
CH0319415912	0.0000 % PSHYPO 0 07/02/21 626	1'400	0	100	1'300	CHF	100.86%	1'311'180.00	0.06	a)	
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	1'500	0	0	1'500	CHF	96.56%	1'448'400.00	0.07	a)	
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	1'500	0	0	1'500	CHF	96.62%	1'449'300.00	0.07	a)	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	4'750	0	0	4'750	CHF	96.90%	4'602'750.00	0.22	a)	
CH0319415953	0.5500 % CS 0.55 04/15/24 EMTN	1'200	0	500	700	CHF	100.95%	706'650.00	0.03	a)	
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	3'200	0	500	2'700	CHF	101.55%	2'741'850.00	0.13	a)	
CH0319415979	1.7500 % GRANDX 1 3/4 05/12/22	500	0	0	500	CHF	104.40%	522'000.00	0.03	a)	
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	1'450	0	0	1'450	CHF	99.35%	1'440'575.00	0.07	a)	
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	99.25%	1'191'000.00	0.06	a)	
CH0319416001	2.2500 % GLENLN 2 1/4 05/10/21 EMTN	800	700	100	1'400	CHF	107.15%	1'500'100.00	0.07	a)	
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	0	1'450	0	1'450	CHF	95.50%	1'384'750.00	0.07	a)	
CH0319932767	0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31	1'100	0	0	1'100	CHF	95.80%	1'053'800.00	0.05	a)	
CH0320297895	0.7500 % DB 0 3/4 07/05/21 EMTN	900	0	100	800	CHF	101.90%	815'200.00	0.04	a)	
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	1'700	0	0	1'700	CHF	99.30%	1'688'100.00	0.08	a)	
CH0320712604	0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31	1'450	0	0	1'450	CHF	98.65%	1'430'425.00	0.07	a)	
CH0323440104	0.3000 % SWICAR 0.3 04/18/20	1'700	0	100	1'600	CHF	101.20%	1'619'200.00	0.08	a)	
CH0323440112	1.6250 % AKEB 1 5/8 06/09/23	600	0	0	600	CHF	100.85%	605'100.00	0.03	a)	
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	700	0	0	700	CHF	96.65%	676'550.00	0.03	a)	
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	1'350	825	0	2'175	CHF	100.15%	2'178'262.50	0.11	a)	
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	98.75%	1'678'750.00	0.08	a)	
CH0323735610	0.0000 % PSHYPO 0 07/05/22 630	2'500	0	0	2'500	CHF	100.60%	2'515'000.00	0.12	a)	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	2'500	0	0	2'500	CHF	97.51%	2'437'750.00	0.12	a)	
CH0323735651	1.5000 % PEMEX 1 1/2 06/14/18 EMTN	700	0	100	600	CHF	101.05%	606'300.00	0.03	a)	
CH0323735669	2.3750 % PEMEX 2 3/8 12/14/21 EMTN	600	400	100	900	CHF	106.05%	954'450.00	0.05	a)	
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	850	0	0	850	CHF	99.40%	844'900.00	0.04	a)	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	99.40%	1'789'200.00	0.09	a)	
CH0325429196	1.3750 % NIBCAP 1 3/8 06/17/19 EMTN	350	0	100	250	CHF	102.00%	255'000.00	0.01	a)	



ISIN	Bezeichnung	Anzahl /	Kufe /	Verkufe /	Anzahl /	Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.	
		Nominal in	Zugange	Abgange	Nominal in						
		Tsd.	2)	3)	Tsd.						
		01.02.2017				31.07.2017					
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	2'250	0	0	2'250	CHF	93.45%	2'102'625.00	0.10	a)	
CH0326213953	0.7500 % KISPIZ 0 3/4 07/28/36	0	1'000	0	1'000	CHF	102.70%	1'027'000.00	0.05	a)	
CH0326371389	0.1300 % SCARD 0.13 06/15/19 A	380	1'000	100	1'280	CHF	100.70%	1'288'960.00	0.06	a)	
CH0326371413	0.7500 % FCACCH 0 3/4 11/29/21	600	0	100	500	CHF	101.15%	505'750.00	0.02	a)	
CH0326371421	1.0000 % HIAGSW 1 07/04/23	700	0	0	700	CHF	102.00%	714'000.00	0.03	a)	
CH0326371439	0.2500 % COOPSW 0 1/4 09/30/22	250	0	0	250	CHF	100.30%	250'750.00	0.01	a)	
CH0326371454	0.3750 % SUNSW 0 3/8 07/11/22	1'800	0	0	1'800	CHF	101.05%	1'818'900.00	0.09	a)	
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	1'200	0	0	1'200	CHF	101.65%	1'219'800.00	0.06	a)	
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	185	0	0	185	CHF	97.90%	181'115.00	0.01	a)	
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN	1'100	0	0	1'100	CHF	101.15%	1'112'650.00	0.05	a)	
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	3'500	300	0	3'800	CHF	92.37%	3'510'060.00	0.17	a)	
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	500	0	0	500	CHF	98.70%	493'500.00	0.02	a)	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	1'500	0	0	1'500	CHF	92.00%	1'380'000.00	0.07	a)	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	1'400	0	0	1'400	CHF	104.35%	1'460'900.00	0.07	a)	
CH0330049856	0.8500 % AFRFIN 0.85 12/27/19	600	0	100	500	CHF	101.05%	505'250.00	0.02	a)	
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	1'300	0	0	1'300	CHF	103.50%	1'345'500.00	0.07	a)	
CH0330143170	0.0000 % PSPNSW 0 09/01/23	350	0	0	350	CHF	99.15%	347'025.00	0.02	a)	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	800	0	0	800	CHF	95.90%	767'200.00	0.04	a)	
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	900	1'600	0	2'500	CHF	90.26%	2'256'500.00	0.11	a)	
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	450	0	0	450	CHF	98.75%	444'375.00	0.02	a)	
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	350	0	0	350	CHF	92.35%	323'225.00	0.02	a)	
CH0331455326	0.0000 % KTBS 0 09/05/23	700	0	0	700	CHF	100.45%	703'150.00	0.03	a)	
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	800	0	0	800	CHF	98.45%	787'600.00	0.04	a)	
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	550	0	0	550	CHF	96.75%	532'125.00	0.03	a)	
CH0333827472	0.1250 % TEVA 0 1/8 07/27/18	900	0	100	800	CHF	100.36%	802'880.00	0.04	a)	
CH0333827498	0.5000 % TEVA 0 1/2 07/28/22	1'000	800	0	1'800	CHF	100.75%	1'813'500.00	0.09	a)	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	900	0	0	900	CHF	100.00%	900'000.00	0.04	a)	
CH0336352734	0.0000 % PSHYPO 0 03/26/21 634	1'700	1'400	100	3'000	CHF	100.95%	3'028'500.00	0.15	a)	
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	1'050	0	0	1'050	CHF	93.90%	985'950.00	0.05	a)	
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	900	600	0	1'500	CHF	89.19%	1'337'850.00	0.07	a)	
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	700	0	0	700	CHF	88.50%	619'500.00	0.03	a)	
CH0336352775	0.1250 % SCMNVS 0 1/8 09/15/32	1'600	0	0	1'600	CHF	89.85%	1'437'600.00	0.07	a)	
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	700	0	0	700	CHF	99.10%	693'700.00	0.03	a)	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	1'700	2'200	0	3'900	CHF	99.53%	3'881'670.00	0.19	a)	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	1'500	0	0	1'500	CHF	97.29%	1'459'350.00	0.07	a)	
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	2'000	600	0	2'600	CHF	94.00%	2'444'000.00	0.12	a)	
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	500	0	0	500	CHF	99.80%	499'000.00	0.02	a)	
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	1'400	0	0	1'400	CHF	92.50%	1'295'000.00	0.06	a)	
CH0337645516	0.5500 % IRENSW 0.55 11/15/21	600	0	100	500	CHF	100.40%	502'000.00	0.02	a)	
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	1'260	0	0	1'260	CHF	98.85%	1'245'510.00	0.06	a)	
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	1'100	0	0	1'100	CHF	97.36%	1'070'960.00	0.05	a)	
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	91.95%	1'471'200.00	0.07	a)	
CH0338330407	0.0000 % PSHYPO 0 05/16/23 638	1'400	0	0	1'400	CHF	100.03%	1'400'420.00	0.07	a)	
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	1'600	0	0	1'600	CHF	92.57%	1'481'120.00	0.07	a)	
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	820	0	0	820	CHF	89.95%	737'590.00	0.04	a)	
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	2'230	0	0	2'230	CHF	97.55%	2'175'365.00	0.11	a)	
CH0338330449	0.1250 % VORHYP 0 1/8 10/06/21 EMTN	700	0	100	600	CHF	99.85%	599'100.00	0.03	a)	
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	500	0	0	500	CHF	98.65%	493'250.00	0.02	a)	
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	1'200	0	0	1'200	CHF	91.50%	1'098'000.00	0.05	a)	
CH0338330498	0.0100 % BAWAG 0.01 09/15/21 EMTN	1'400	0	100	1'300	CHF	99.10%	1'288'300.00	0.06	a)	
CH0340677779	0.1250 % HYN0E 0 1/8 10/17/23 EMTN	1'030	0	0	1'030	CHF	98.55%	1'015'065.00	0.05	a)	
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	700	1'000	0	1'700	CHF	95.85%	1'629'450.00	0.08	a)	
CH0340912143	0.0000 % SOONVS 0 10/11/19	1'300	0	100	1'200	CHF	100.20%	1'202'400.00	0.06	a)	
CH0340912150	0.0100 % SOONVS 0.01 10/11/21	850	1'000	100	1'750	CHF	100.10%	1'751'750.00	0.09	a)	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.80%	1'008'000.00	0.05	a)	
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	400	0	0	400	CHF	99.30%	397'200.00	0.02	a)	
CH0341440300	0.3000 % PBBGR 0.3 11/02/21 EMTN	500	0	100	400	CHF	100.10%	400'400.00	0.02	a)	
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	500	0	0	500	CHF	87.15%	435'750.00	0.02	a)	
CH0341725858	0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN	2'980	0	0	2'980	CHF	99.35%	2'960'630.00	0.14	a)	
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	96.10%	1'153'200.00	0.06	a)	
CH0341725908	0.1250 % LONNVX 0 1/8 11/01/21	1'100	0	100	1'000	CHF	99.60%	996'000.00	0.05	a)	
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	800	0	0	800	CHF	85.60%	684'800.00	0.03	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl /		Kufe /	Verkufe /	Anzahl /		Wahrung	Kurs	Kurswert	in %	Kat.
		Nominal in	Tsd.			Nominal in	Tsd.					
		01.02.2017		2)	3)	31.07.2017						
CH0341725940	2.1250 % TANNER 2 1/8 11/15/19	350	0	0	100	250	CHF	102.10%	255'250.00	0.01	a)	
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	900	0	0	0	900	CHF	97.00%	873'000.00	0.04	a)	
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	1'200	0	0	0	1'200	CHF	89.10%	1'069'200.00	0.05	a)	
CH0343366776	0.0000 % GIVNVX 0 12/07/22	340	0	0	0	340	CHF	99.80%	339'320.00	0.02	a)	
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	950	0	0	0	950	CHF	96.80%	919'600.00	0.04	a)	
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'000	0	0	0	1'000	CHF	93.95%	939'500.00	0.05	a)	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	1'400	0	0	0	1'400	CHF	94.85%	1'327'900.00	0.06	a)	
CH0343366826	0.0000 % PSHYPO 0 02/14/22 642	2'900	0	0	0	2'900	CHF	100.70%	2'920'300.00	0.14	a)	
CH0344583783	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 12/15/27	600	500	0	0	1'100	CHF	98.30%	1'081'300.00	0.05	a)	
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	2'900	0	0	0	2'900	CHF	100.75%	2'921'750.00	0.14	a)	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	2'800	1'600	0	0	4'400	CHF	100.09%	4'403'960.00	0.21	a)	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	2'300	0	0	0	2'300	CHF	99.33%	2'284'590.00	0.11	a)	
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	900	0	0	0	900	CHF	98.60%	887'400.00	0.04	a)	
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	350	0	0	0	350	CHF	97.95%	342'825.00	0.02	a)	
CH0344958415	4.0000 % SWISS 4 01/06/49 FEB	0	800	800	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958423	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26 MAR	0	700	700	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958431	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 MAR	0	900	900	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958449	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 APR	0	1'000	1'000	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958456	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58 APR	0	600	600	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958464	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27 MAY	0	750	750	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	0	1'150	0	1'150	1'150	CHF	104.15%	1'197'725.00	0.06	a)	
CH0344958480	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26 JUNE	0	600	600	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	0	1'800	0	1'800	1'800	CHF	103.05%	1'854'900.00	0.09	a)	
CH0344958506	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 JUL	0	850	850	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0344958514	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 0000	0	450	450	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0345536517	0.0000 % KTBS 0 11/24/21	1'200	0	100	1'100	1'100	CHF	101.25%	1'113'750.00	0.05	a)	
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	700	0	0	0	700	CHF	97.50%	682'500.00	0.03	a)	
CH0346461772	0.3500 % BSANCI 0.35 05/30/25 EMTN	450	0	0	0	450	CHF	97.75%	439'875.00	0.02	a)	
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	1'500	0	0	1'500	1'500	CHF	99.05%	1'485'750.00	0.07	a)	
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	1'500	0	0	1'500	1'500	CHF	99.65%	1'494'750.00	0.07	a)	
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	800	0	0	0	800	CHF	99.30%	794'400.00	0.04	a)	
CH0347082817	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36 FEB	800	0	800	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	1'100	0	0	1'100	1'100	CHF	99.15%	1'090'650.00	0.05	a)	
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	1'700	0	0	1'700	1'700	CHF	97.95%	1'665'150.00	0.08	a)	
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	800	0	0	0	800	CHF	99.05%	792'400.00	0.04	a)	
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	400	0	0	400	400	CHF	99.69%	398'760.00	0.02	a)	
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	1'300	0	0	1'300	1'300	CHF	98.25%	1'277'250.00	0.06	a)	
CH0347556935	0.2000 % HYNOE 0.2 03/31/22 EMTN	250	0	0	250	250	CHF	100.20%	250'500.00	0.01	a)	
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	1'000	0	0	1'000	1'000	CHF	99.20%	992'000.00	0.05	a)	
CH0350030422	0.7000 % KWOBER 0.7 01/30/26	900	0	0	900	900	CHF	100.65%	905'850.00	0.04	a)	
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	2'500	0	0	2'500	2'500	CHF	99.50%	2'487'500.00	0.12	a)	
CH0352595851	0.2000 % WKBNSW 0.2 02/02/26	700	0	0	700	700	CHF	98.85%	691'950.00	0.03	a)	
CH0352595869	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/19	300	0	100	200	200	CHF	100.10%	200'200.00	0.01	a)	
CH0352595877	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 FEB	1'600	0	1'600	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	2'200	1'100	0	3'300	3'300	CHF	100.15%	3'304'950.00	0.16	a)	
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	0	1'700	0	1'700	1'700	CHF	98.78%	1'679'260.00	0.08	a)	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	1'000	0	0	1'000	1'000	CHF	101.05%	1'010'500.00	0.05	a)	
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	1'300	0	0	1'300	1'300	CHF	99.25%	1'290'250.00	0.06	a)	
CH0353427989	0.7000 % ZUGNSW 0.7 02/17/22	500	0	0	500	500	CHF	101.90%	509'500.00	0.02	a)	
CH0353428029	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 FEB	0	900	900	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	0	1'600	0	1'600	1'600	CHF	99.95%	1'599'200.00	0.08	a)	
CH0353428045	0.0000 % ARGOVI 0 02/17/22	0	900	0	900	900	CHF	101.30%	911'700.00	0.04	a)	
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	0	1'100	0	1'100	1'100	CHF	99.85%	1'098'350.00	0.05	a)	
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	0	1'100	0	1'100	1'100	CHF	100.35%	1'103'850.00	0.05	a)	
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	0	3'000	0	3'000	3'000	CHF	98.80%	2'964'000.00	0.14	a)	
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	500	0	0	500	500	CHF	99.95%	499'750.00	0.02	a)	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	0	800	0	800	800	CHF	99.00%	792'000.00	0.04	a)	
CH0353945402	0.4000 % SOCGEN 0.4 02/22/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	1'000	CHF	100.10%	1'001'000.00	0.05	a)	
CH0354836089	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 FEB	0	2'200	2'200	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0354836097	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 FEB	0	1'100	1'100	0	0	CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	0	800	0	800	800	CHF	99.60%	796'800.00	0.04	a)	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	850	0	0	850	850	CHF	99.40%	844'900.00	0.04	a)	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Käufe / Verkäufe / Anzahl / Wahrung			Kurs	Kurswert	in %	Kat.
		Nominal in Tsd. 01.02.2017	Zugange 2)	Abgange 3)				
CH0357483152	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36 MAR	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLILI 2 12/11/23	0	300	0	300 CHF	103.60%	310'800.00	0.02 a)
CH0357483178	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 FEB	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0357483186	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 FEB	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	0	900	0	900 CHF	98.00%	882'000.00	0.04 a)
CH0357483210	0.1400 % SWMOBI 0.14 12/16/19 A	0	2'040	1'020	1'020 CHF	100.65%	1'026'630.00	0.05 a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	98.55%	1'182'600.00	0.06 a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	0	500	0	500 CHF	98.40%	492'000.00	0.02 a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	0	800	0	800 CHF	100.15%	801'200.00	0.04 a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	0	1'800	0	1'800 CHF	99.72%	1'794'960.00	0.09 a)
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	0	1'300	0	1'300 CHF	100.88%	1'311'440.00	0.06 a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	0	500	0	500 CHF	98.95%	494'750.00	0.02 a)
CH0358181219	0.7500 % DB 0 3/4 03/21/22 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	101.35%	1'114'850.00	0.05 a)
CH0358654934	0.4500 % ACAFP 0.45 03/14/22 EMTN	0	600	0	600 CHF	100.75%	604'500.00	0.03 a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	0	800	0	800 CHF	96.60%	772'800.00	0.04 a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	0	3'450	0	3'450 CHF	99.35%	3'427'575.00	0.17 a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	1'100	0	1'100 CHF	99.25%	1'091'750.00	0.05 a)
CH0359915433	1.0050 % BREPW 1.005 03/28/23 EMTN	0	700	0	700 CHF	101.35%	709'450.00	0.03 a)
CH0360172685	0.0500 % MDLZ 0.05 03/30/20	0	900	0	900 CHF	99.95%	899'550.00	0.04 a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	0	500	0	500 CHF	100.40%	502'000.00	0.02 a)
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	0	400	0	400 CHF	98.75%	395'000.00	0.02 a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	100.00%	1'200'000.00	0.06 a)
CH0360172750	1.3750 % ELEM 1 3/8 11/02/22	0	450	0	450 CHF	101.50%	456'750.00	0.02 a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	0	2'600	0	2'600 CHF	99.50%	2'587'000.00	0.13 a)
CH0360172776	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 APR	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	0	1'100	0	1'100 CHF	99.80%	1'097'800.00	0.05 a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	0	1'100	0	1'100 CHF	99.95%	1'099'450.00	0.05 a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	0	1'600	0	1'600 CHF	99.09%	1'585'440.00	0.08 a)
CH0361532838	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 APR	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	0	1'600	0	1'600 CHF	99.80%	1'596'800.00	0.08 a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNVX 0.15 06/07/24	0	1'200	0	1'200 CHF	98.85%	1'186'200.00	0.06 a)
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	0	600	0	600 CHF	100.70%	604'200.00	0.03 a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	0	800	0	800 CHF	100.03%	800'240.00	0.04 a)
CH0361532937	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 JUNE	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	0	1'400	0	1'400 CHF	101.65%	1'423'100.00	0.07 a)
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	0	700	0	700 CHF	97.85%	684'950.00	0.03 a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	0	2'100	0	2'100 CHF	100.58%	2'112'180.00	0.10 a)
CH0361533075	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 JUL	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 0	0	800	0	800 CHF	100.27%	802'144.00	0.04 a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	0	400	0	400 CHF	100.08%	400'312.00	0.02 a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	0	600	0	600 CHF	100.05%	600'300.00	0.03 a)
CH0362257997	0.5000 % RENAUL 0 1/2 04/20/22 EMTN	0	900	0	900 CHF	101.00%	909'000.00	0.04 a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	0	500	0	500 CHF	98.20%	491'000.00	0.02 a)
CH0362748300	0.8000 % HIAGSW 0.8 05/30/22	0	220	0	220 CHF	101.05%	222'310.00	0.01 a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	0	1'000	0	1'000 CHF	100.41%	1'004'100.00	0.05 a)
CH0362748334	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 MAY	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	0	800	0	800 CHF	99.20%	793'600.00	0.04 a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 05/31/27	0	1'400	0	1'400 CHF	99.50%	1'393'000.00	0.07 a)
CH0363129492	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28 APR	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	0	700	0	700 CHF	101.10%	707'700.00	0.03 a)
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	0	300	0	300 CHF	96.95%	290'850.00	0.01 a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	99.85%	1'098'350.00	0.05 a)
CH0365501508	0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN	0	800	0	800 CHF	99.65%	797'200.00	0.04 a)
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	0	1'800	800	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.05 a)
CH0367013973	0.0000 % HYN0E 0 12/30/20 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.85%	998'500.00	0.05 a)
CH0367204986	0.4500 % EFIAGC 0.45 07/11/22	0	900	0	900 CHF	100.05%	900'450.00	0.04 a)
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	100.15%	2'704'050.00	0.13 a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	99.65%	1'793'700.00	0.09 a)
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	101.35%	1'621'600.00	0.08 a)
CH0367206692	0.5000 % GALESW 0 1/2 06/15/23	0	900	0	900 CHF	100.15%	901'350.00	0.04 a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	0	600	0	600 CHF	101.00%	606'000.00	0.03 a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	0	500	0	500 CHF	99.60%	498'000.00	0.02 a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Käufe / Verkäufe / Anzahl /			Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		Nominal in Tsd. 01.02.2017	Zugänge 2)	Abgänge 3)					
CH0367206734	0.2000 % LONNVX 0.2 07/12/21	0	500	0	500 CHF	99.75%	498'750.00	0.02	a)
CH0367206742	0.7000 % LONNVX 0.7 07/12/24	0	500	0	500 CHF	100.00%	500'000.00	0.02	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	98.00%	1'176'000.00	0.06	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	0	1'100	0	1'100 CHF	98.60%	1'084'600.00	0.05	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	0	1'000	0	1'000 CHF	97.50%	975'000.00	0.05	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	0	300	0	300 CHF	98.60%	295'800.00	0.01	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	98.90%	989'000.00	0.05	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	98.70%	1'283'100.00	0.06	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	0	300	0	300 CHF	100.50%	301'500.00	0.01	a)
CH0370943539	0.0000 % PSHYPO 0 11/22/22 650	0	600	0	600 CHF	100.54%	603'240.00	0.03	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	0	1'400	0	1'400 CHF	99.61%	1'394'540.00	0.07	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	0	1'000	0	1'000 CHF	97.43%	974'300.00	0.05	a)
CH0370943612	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26 JUL	0	500	0	500 CHF	98.16%	490'790.00	0.02	a)
CH0373314894	0.1250 % WSTP 0 1/8 12/15/22 EMTN	0	500	0	500 CHF	100.10%	500'500.00	0.02	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.10%	800'800.00	0.04	a)
CH0373945044	0.3750 % JACLIF 0 3/8 07/18/25 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	100.40%	1'104'400.00	0.05	a)
CH0373945051	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 AUG	0	1'500	0	1'500 CHF	97.52%	1'462'800.00	0.07	a)
<b>CHF</b>							<b>2'023'482'076.70</b>	<b>98.73</b>	

#### Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht	9'521'581.12	0.46
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'023'482'076.70	98.73
Sonstige Vermögenswerte	16'585'754.38	0.81
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'049'589'412.20</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-506.09	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'049'588'906.11</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenen Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	2'023'482'076.70	98.73
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

## Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemass Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswahrung	in % des Nettofondsvermogens *
Total der engagementerhohenden Positionen (Basiswertaquivalent)	0.00	0.00
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertaquivalent)	0.00	0.00

\* In Prozent der Risikolimiten (= Nettofondsvermogen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhaltnis der Risikolimiten zum Nettofondsvermogen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so betragt der Limitenfaktor 100 %.

## Spesen zu Gunsten Teilvermogen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung per 31.07.2017

Klasse	Rechnungseinheit	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Rucknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes	
		zu Gunsten Teilvermogen	zu Gunsten Fondsleitung	zu Gunsten Teilvermogen	zu Gunsten Fondsleitung
FA CHF	CHF	0.37	0.00	0.00	0.00
NT CHF	CHF	0.37	0.00	0.00	0.00

## Zusatztliche Informationen und Ausserbilanzgeschafte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten: 0.00

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten: 0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements: Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezuglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

## Pauschale Verwaltungskommission

---

Die pauschale Verwaltungskommission wird verwendet fur die Leitung, die Entschadigung der Depotbank (PAF) fur die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch fur das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermogens.

Im Geschaftsjahr effektiv belastete Satze:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF:

Klasse	Periode	PVK	PAF	PMF
FA CHF	01.02.2016 - 31.07.2017	0.18 %	0.10 %	0.08 %
NT CHF	01.02.2016 - 31.07.2017	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Gemass Richtlinie fur Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebuhren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): Aus der pauschalen Verwaltungskommission konnen Gebuhren bzw. Entschadigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstatigkeit des Teilvermogens bezahlt werden. Als Vertriebstatigkeit gilt insbesondere jede Tatigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Teilvermogens. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Teilvermogen belasteten Gebuhren bzw. Kosten gewahren.

## Benchmark

---

SBI® AAA-BBB Index

## TER

---

Die TER wurde gemass «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der SFAMA - Swiss Funds & Asset Management Association (Stand: 20. April 2015) herausgegeben wurden, ermittelt.

## Erklahrung der Fussnoten (fehlende Fussnoten fur diesen Bericht nicht relevant)

---

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet
- 2) Kaufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Kaufe / Gratistitel / Konversionen / Namensanderungen / Splits / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Ubertrage / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen
- 3) Verkaufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkaufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausubungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Ruckzahlungen / Ubertrage / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen
- 7) Allfallige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zururckzufuhren
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence

## Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

---

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des Teilvermögens oder, falls abweichend, 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Referenzwährung 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 Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe 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 Kommissionsätze 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.