

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

Halbjahresbericht per 31.08.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FA CHF	31562124	CHF
GT CHF	33099984	CHF
NT CHF	11704507	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	36
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	36
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	37
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	37
8	Pauschale Verwaltungskommission	38
9	Benchmark	38
10	TER	38
11	Fussnoten	39
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	40

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2024	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021
	bis	31.08.2024	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'066'127'122.30	3'653'738'924.97	3'184'418'752.04	3'282'408'788.59
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'049'952.04	11'850'469.78	6'098'421.93	7'267'820.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		157'495.900	136'659.787	74'252.964	79'796.528
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		89.2084	86.7151	82.1304	91.0794
Ausschüttung je Anteil		-	0.75	0.80	0.60
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		83'827'580.59	66'824'177.66	41'007'763.38	45'480'423.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		874'746.628	721'392.257	470'716.101	472'969.491
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		95.8307	92.6322	87.1178	96.1593
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		102.0394	97.2126	87.6476	93.3147
Thesaurierung je Anteil		-	0.83	0.68	0.71
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'968'249'589.67	3'575'064'277.53	3'137'312'566.73	3'229'660'544.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'109'136.734	32'540'098.247	30'390'868.552	28'367'371.463
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		113.6862	109.8664	103.2321	113.8512
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		121.0518	115.2989	103.8599	110.4833
Thesaurierung je Anteil		-	1.13	0.96	1.00
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA CHF	3.77 %	7.93 %	-12.91 %	-2.21 %
Klasse GT CHF	3.78 %	7.95 %	-12.90 %	-2.19 %
Klasse NT CHF	3.85 %	8.10 %	-12.77 %	-2.05 %
Benchmark	3.80 %	7.96 %	-12.88 %	-2.16 %
Tracking Error ³³⁾	-	0.06 %	0.09 %	0.05 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FA CHF	-0.03 %
Klasse GT CHF	-0.02 %
Klasse NT CHF	0.05 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	29.02.2024
Bankguthaben auf Sicht	2'739'208.63	7'832'492.95
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'040'563'482.90	3'618'283'331.10
Sonstige Vermögenswerte	22'835'957.77	27'631'851.57
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'066'138'649.30	3'653'747'675.62
Andere Verbindlichkeiten	-11'527.00	-8'750.65
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'066'127'122.30	3'653'738'924.97

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		136'659.787	74'252.964
Ausgegebene Anteile		34'155.648	71'766.640
Zurückgenommene Anteile		-13'319.535	-9'359.817
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		157'495.900	136'659.787

Klasse GT CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		721'392.257	470'716.101
Ausgegebene Anteile		198'891.039	312'931.849
Zurückgenommene Anteile		-45'536.668	-62'255.693
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		874'746.628	721'392.257

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		32'540'098.247	30'390'868.552
Ausgegebene Anteile		622'588.206	5'937'224.800
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		47'204.900	493'225.621
Zurückgenommene Anteile		-498'506.355	-2'356'650.294
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-6'602'248.264	-1'924'570.432
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'109'136.734	32'540'098.247

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	25.06.2024	5'270'545.10	47'204.900

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	26.06.2024	368'086'950.00	3'300'000.000
Klasse NT CHF	11.07.2024	369'418'220.37	3'302'248.264

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'653'738'924.97	3'184'418'752.04
Ausbezahlte Ausschüttung		-103'346.55	-72'330.77
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-13'183'786.68	-10'386'021.59
Saldo aus dem Anteilverkehr		-699'553'517.81	259'876'859.81
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		125'228'848.37	219'901'665.48
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'066'127'122.30	3'653'738'924.97

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		94'614.65	95'795.70
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		19'010'505.76	35'253'832.69
Erträge aus Wertpapierleihe		376'131.60	823'429.50
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		246'206.75	3'263'410.23
Total Ertrag		19'727'458.76	39'436'468.12
Aufwand			
Passivzinsen		-4.60	0.00
Reglementarische Vergütungen		-62'371.42	-93'914.64
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'964'172.61	-1'732'032.28
Total Aufwand		-3'026'548.63	-1'825'946.92
Nettoertrag / Verlust		16'700'910.13	37'610'521.20
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-31'220'478.66	-36'186'487.99
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		254'147.07	2'425'412.42
Realisierter Erfolg		-14'265'421.46	3'849'445.63
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		139'494'269.83	216'052'219.85
Gesamterfolg		125'228'848.37	219'901'665.48

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							3'040'563'482.90	99.17	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							3'040'563'482.90	99.17	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	50'360	0	11'184	39'176 CHF	112.44%	44'049'494.40	1.44	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	25'099	0	5'282	19'817 CHF	181.70%	36'007'489.00	1.17	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	40'874	2'400	10'440	32'834 CHF	125.61%	41'242'787.40	1.35	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	4'250	0	900	3'350 CHF	110.60%	3'705'100.00	0.12	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	2'190	0	2'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'160	0	800	1'360 CHF	101.73%	1'383'528.00	0.05	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	4'340	250	1'350	3'240 CHF	118.45%	3'837'780.00	0.13	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	1'150	0	200	950 CHF	102.32%	972'040.00	0.03	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	40'524	0	8'612	31'912 CHF	122.98%	39'245'377.60	1.28	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	9'210	0	2'650	6'560 CHF	103.55%	6'792'880.00	0.22	a)
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	3'160	0	625	2'535 CHF	106.40%	2'697'240.00	0.09	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	27'315	0	5'812	21'503 CHF	107.64%	23'145'829.20	0.75	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	1'400	0	0	1'400 CHF	109.11%	1'527'540.00	0.05	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	2'700	0	895	1'805 CHF	100.97%	1'822'508.50	0.06	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	2'325	0	580	1'745 CHF	105.35%	1'838'357.50	0.06	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	7'600	0	2'600	5'000 CHF	109.61%	5'480'500.00	0.18	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	4'420	0	980	3'440 CHF	101.00%	3'474'400.00	0.11	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	8'000	0	2'035	5'965 CHF	106.12%	6'330'058.00	0.21	a)
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	2'690	0	735	1'955 CHF	107.35%	2'098'692.50	0.07	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	1'675	0	500	1'175 CHF	101.80%	1'196'150.00	0.04	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	6'000	0	2'000	4'000 CHF	101.25%	4'050'000.00	0.13	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	500	0	0	500 CHF	106.85%	534'250.00	0.02	a)
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	800	0	0	800 CHF	112.00%	896'000.00	0.03	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'560	0	0	2'560 CHF	108.85%	2'786'560.00	0.09	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	2'040	0	750	1'290 CHF	105.15%	1'356'435.00	0.04	a)
CH0119983077	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 11/26/35	1'800	0	0	1'800 CHF	107.70%	1'938'600.00	0.06	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	6'110	0	950	5'160 CHF	104.97%	5'416'452.00	0.18	a)
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	1'670	0	0	1'670 CHF	112.35%	1'876'245.00	0.06	a)
CH0120847899	2.1250 % SGKNSW 2 1/8 12/27/40	300	600	0	900 CHF	115.60%	1'040'400.00	0.03	a)
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	1'480	0	450	1'030 CHF	101.97%	1'050'291.00	0.03	a)
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	3'500	0	0	3'500 CHF	103.83%	3'634'050.00	0.12	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	8'895	0	2'185	6'710 CHF	110.33%	7'403'143.00	0.24	a)
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	750	0	0	750 CHF	123.50%	926'250.00	0.03	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	4'200	0	1'205	2'995 CHF	102.48%	3'069'276.00	0.10	a)
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	550	0	0	550 CHF	119.45%	656'975.00	0.02	a)
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	820	0	0	820 CHF	124.65%	1'022'130.00	0.03	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'740	0	350	1'390 CHF	102.35%	1'422'665.00	0.05	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	29'963	0	6'380	23'583 CHF	111.80%	26'365'794.00	0.86	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	39'029	0	8'816	30'213 CHF	117.39%	35'467'040.70	1.16	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	35'905	0	7'549	28'356 CHF	109.87%	31'154'737.20	1.02	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	3'495	0	805	2'690 CHF	102.28%	2'751'332.00	0.09	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	1'160	0	250	910 CHF	108.65%	988'715.00	0.03	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	880	0	450	430 CHF	110.60%	475'580.00	0.02	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	4'110	2'700	755	6'055 CHF	104.19%	6'308'704.50	0.21	a)
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	1'495	0	0	1'495 CHF	122.60%	1'832'870.00	0.06	a)
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	1'400	0	520	880 CHF	109.70%	965'360.00	0.03	a)
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	535	0	0	535 CHF	104.45%	558'807.50	0.02	a)
CH0132163434	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 06/30/31	595	0	0	595 CHF	109.50%	651'525.00	0.02	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	2'740	0	2'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	1'600	0	850	750 CHF	101.90%	764'250.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	4'430	0	835	3'595 CHF	101.65%	3'654'317.50	0.12	a)
CH0137992803	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41	1'100	1'100	625	1'575 CHF	113.80%	1'792'350.00	0.06	a)
CH0138276859	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 10/04/41	2'500	0	250	2'250 CHF	114.45%	2'575'125.00	0.08	a)
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'700	0	1'000	700 CHF	100.87%	706'090.00	0.02	a)
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	1'255	0	300	955 CHF	102.30%	976'965.00	0.03	a)
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	1'600	0	650	950 CHF	117.05%	1'111'975.00	0.04	a)
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	700	0	0	700 CHF	101.05%	707'350.00	0.02	a)
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	3'420	0	0	3'420 CHF	109.23%	3'735'666.00	0.12	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	2'200	300	1'100	1'400 CHF	101.20%	1'416'800.00	0.05	a)
CH0143808365	1.5000 % BVZNSW 1 1/2 04/12/32	950	0	150	800 CHF	104.75%	838'000.00	0.03	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	5'095	0	0	5'095 CHF	101.91%	5'192'314.50	0.17	a)
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	2'055	0	0	2'055 CHF	106.27%	2'183'848.50	0.07	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	2'865	500	850	2'515 CHF	104.75%	2'634'462.50	0.09	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'350	200	410	1'140 CHF	101.25%	1'154'250.00	0.04	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42	1'145	0	200	945 CHF	113.85%	1'075'882.50	0.04	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	6'300	0	1'295	5'005 CHF	101.13%	5'061'556.50	0.17	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	2'400	0	900	1'500 CHF	105.20%	1'578'000.00	0.05	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'000	0	0	1'000 CHF	101.30%	1'013'000.00	0.03	a)
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	855	0	200	655 CHF	110.80%	725'740.00	0.02	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	910	0	505	405 CHF	101.60%	411'480.00	0.01	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	6'050	0	1'495	4'555 CHF	102.46%	4'667'053.00	0.15	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	7'695	0	1'560	6'135 CHF	101.53%	6'228'865.50	0.20	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	33'342	0	33'342	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	1'350	0	130	1'220 CHF	105.80%	1'290'760.00	0.04	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	2'335	0	950	1'385 CHF	101.85%	1'410'622.50	0.05	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	6'770	0	1'310	5'460 CHF	102.55%	5'599'230.00	0.18	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	1'400	0	0	1'400 CHF	101.05%	1'414'700.00	0.05	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	1'015	0	0	1'015 CHF	103.40%	1'049'510.00	0.03	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'450	0	0	1'450 CHF	101.40%	1'470'300.00	0.05	a)
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	1'585	0	0	1'585 CHF	100.90%	1'599'265.00	0.05	a)
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	1'400	0	300	1'100 CHF	105.80%	1'163'800.00	0.04	a)
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	6'230	0	1'460	4'770 CHF	104.00%	4'960'800.00	0.16	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	4'990	0	2'285	2'705 CHF	101.31%	2'740'435.50	0.09	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	1'750	0	400	1'350 CHF	101.35%	1'368'225.00	0.04	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	8'005	0	2'430	5'575 CHF	102.13%	5'693'747.50	0.19	a)
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	1'300	250	440	1'110 CHF	100.90%	1'119'990.00	0.04	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	1'200	0	0	1'200 CHF	120.70%	1'448'400.00	0.05	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	1'490	0	0	1'490 CHF	104.80%	1'561'520.00	0.05	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'350	0	0	1'350 CHF	102.35%	1'381'725.00	0.05	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	1'500	0	600	900 CHF	100.25%	902'250.00	0.03	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	2'850	0	0	2'850 CHF	103.85%	2'959'725.00	0.10	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	2'000	0	600	1'400 CHF	101.10%	1'415'400.00	0.05	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	2'750	0	0	2'750 CHF	103.65%	2'850'375.00	0.09	a)
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	1'210	0	1'210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	870	0	0	870 CHF	105.90%	921'330.00	0.03	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	2'700	0	720	1'980 CHF	101.45%	2'008'710.00	0.07	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	8'270	0	2'745	5'525 CHF	101.38%	5'601'245.00	0.18	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	1'600	0	0	1'600 CHF	102.85%	1'645'600.00	0.05	a)
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	1'700	0	0	1'700 CHF	103.10%	1'752'700.00	0.06	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	800	0	0	800 CHF	112.00%	896'000.00	0.03	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	1'650	0	510	1'140 CHF	102.45%	1'167'930.00	0.04	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	2'450	0	2'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	1'750	0	495	1'255 CHF	101.15%	1'269'432.50	0.04	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'795	0	350	1'445 CHF	112.45%	1'624'902.50	0.05	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	1'100	0	0	1'100 CHF	102.10%	1'123'100.00	0.04	a)
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	1'200	0	270	930 CHF	121.40%	1'129'020.00	0.04	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	2'585	0	0	2'585 CHF	107.45%	2'777'582.50	0.09	a)
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	1'200	0	0	1'200 CHF	105.55%	1'266'600.00	0.04	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'000	0	450	550 CHF	102.30%	562'650.00	0.02	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	2'815	0	2'815	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	7'290	0	1'770	5'520 CHF	103.81%	5'730'312.00	0.19	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	2'050	0	1'295	755 CHF	108.30%	871'665.00	0.03	a)
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	0650	0	0	650 CHF	112.60%	731'900.00	0.02	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'900	0	795	1'105 CHF	102.70%	1'134'835.00	0.04	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	940	0	150	790 CHF	115.95%	916'005.00	0.03	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	3'800	0	750	3'050 CHF	102.10%	3'114'050.00	0.10	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	1'360	0	600	760 CHF	103.75%	788'500.00	0.03	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	7'715	0	7'715	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	2'300	0	750	1'550 CHF	103.80%	1'608'900.00	0.05	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	1'900	0	200	1'700 CHF	114.90%	1'953'300.00	0.06	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'150	0	0	1'150 CHF	101.60%	1'168'400.00	0.04	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	2'540	0	290	2'250 CHF	115.65%	2'602'125.00	0.08	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	3'000	0	500	2'500 CHF	101.19%	2'529'750.00	0.08	a)
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'300	0	520	780 CHF	111.40%	868'920.00	0.03	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	2'020	0	500	1'520 CHF	101.80%	1'547'360.00	0.05	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	2'000	0	670	1'330 CHF	107.05%	1'423'765.00	0.05	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	33'717	0	7'168	26'549 CHF	101.20%	26'867'588.00	0.88	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	29'866	0	6'076	23'790 CHF	163.00%	38'777'700.00	1.26	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	32'558	1'900	8'398	26'060 CHF	100.01%	26'062'606.00	0.85	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	20'643	500	3'102	18'041 CHF	103.24%	18'625'528.40	0.61	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	42'132	2'300	9'234	35'198 CHF	97.67%	34'377'886.60	1.12	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	4'615	0	1'450	3'165 CHF	110.75%	3'505'237.50	0.11	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	1'130	0	500	630 CHF	110.70%	697'410.00	0.02	a)
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	900	0	200	700 CHF	100.80%	705'600.00	0.02	a)
CH0228138274	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/38	300	600	250	650 CHF	114.50%	744'250.00	0.02	a)
CH0228138282	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/43	900	0	350	550 CHF	119.65%	658'075.00	0.02	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLILU 2 3/8 12/10/26	1'600	0	450	1'150 CHF	102.40%	1'177'600.00	0.04	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	500	0	0	500 CHF	119.55%	597'750.00	0.02	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	3'000	1'800	1'880	2'920 CHF	109.78%	3'205'576.00	0.10	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	2'700	0	1'320	1'380 CHF	117.90%	1'627'020.00	0.05	a)
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	750	0	0	750 CHF	117.65%	882'375.00	0.03	a)
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	7'550	0	1'745	5'805 CHF	101.25%	5'877'562.50	0.19	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	1'150	0	300	850 CHF	104.30%	886'550.00	0.03	a)
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	1'540	0	0	1'540 CHF	119.66%	1'842'764.00	0.06	a)
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29	1'400	0	400	1'000 CHF	102.50%	1'025'000.00	0.03	a)
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	5'500	0	1'645	3'855 CHF	100.75%	3'883'912.50	0.13	a)
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	1'350	0	150	1'200 CHF	102.95%	1'235'400.00	0.04	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	4'300	0	1'475	2'825 CHF	102.40%	2'892'800.00	0.09	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	0	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.03	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	2'600	0	865	1'735 CHF	103.85%	1'801'797.50	0.06	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 07/14/26	1'685	0	300	1'385 CHF	100.95%	1'398'157.50	0.05	a)
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	855	0	0	855 CHF	100.35%	857'992.50	0.03	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	104.85%	1'048'500.00	0.03	a)
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'320	0	320	1'000 CHF	102.50%	1'025'000.00	0.03	a)
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'700	0	600	2'100 CHF	100.65%	2'113'650.00	0.07	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	3'290	300	850	2'740 CHF	105.45%	2'889'330.00	0.09	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'550	0	0	1'550 CHF	101.70%	1'576'350.00	0.05	a)
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	2'150	0	1'105	1'045 CHF	100.55%	1'050'747.50	0.03	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	1'300	0	150	1'150 CHF	101.75%	1'170'125.00	0.04	a)
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	0	80	80	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254147504	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 09/28/29	1'350	0	300	1'050 CHF	102.35%	1'074'675.00	0.04	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	2'180	0	1'200	980 CHF	100.80%	987'840.00	0.03	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	3'350	0	1'000	2'350 CHF	100.17%	2'353'995.00	0.08	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	6'750	0	1'075	5'675 CHF	102.92%	5'840'710.00	0.19	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	1'630	0	805	825 CHF	104.56%	862'620.00	0.03	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	3'340	1'800	0	5'140 CHF	101.49%	5'216'586.00	0.17	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	1'205	0	1'205	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	2'590	0	0	2'590 CHF	106.65%	2'762'235.00	0.09	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	2'400	0	700	1'700 CHF	99.15%	1'685'550.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	2'300	0	750	1'550 CHF	99.50%	1'542'250.00	0.05	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	9'845	0	2'620	7'225 CHF	100.27%	7'244'507.50	0.24	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	8'565	0	8'565	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	3'050	0	3'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	1'050	0	350	700 CHF	98.80%	691'600.00	0.02	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	7'400	500	2'175	5'725 CHF	97.00%	5'553'250.00	0.18	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	2'000	0	150	1'850 CHF	99.01%	1'831'685.00	0.06	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	1'450	0	580	870 CHF	97.70%	849'990.00	0.03	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	855	0	855	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	2'105	500	1'000	1'605 CHF	97.30%	1'561'665.00	0.05	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	8'070	0	2'260	5'810 CHF	98.20%	5'705'420.00	0.19	a)
CH0268988182	1.0000 % SCMNVD 1 04/17/35	2'525	400	900	2'025 CHF	97.60%	1'976'400.00	0.06	a)
CH0269382088	0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30	1'300	0	600	700 CHF	97.60%	683'200.00	0.02	a)
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	1'900	0	655	1'245 CHF	98.35%	1'224'457.50	0.04	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	1'150	0	700	450 CHF	98.30%	442'350.00	0.01	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	1'045	0	0	1'045 CHF	97.55%	1'019'397.50	0.03	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	2'150	0	500	1'650 CHF	98.05%	1'617'825.00	0.05	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	4'305	0	4'305	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	4'760	800	1'700	3'860 CHF	98.20%	3'790'520.00	0.12	a)
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	3'085	0	1'700	1'385 CHF	99.50%	1'378'075.00	0.04	a)
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	2'600	0	400	2'200 CHF	103.30%	2'272'600.00	0.07	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	750	0	0	750 CHF	98.65%	739'875.00	0.02	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	7'775	0	1'085	6'690 CHF	98.46%	6'586'974.00	0.21	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	4'770	0	0	4'770 CHF	98.11%	4'679'847.00	0.15	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	1'685	0	300	1'385 CHF	98.65%	1'366'302.50	0.04	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'200	0	0	1'200 CHF	102.35%	1'228'200.00	0.04	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	5'750	0	5'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	8'050	0	2'125	5'925 CHF	98.45%	5'833'162.50	0.19	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27	1'995	0	1'250	745 CHF	98.75%	735'687.50	0.02	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	1'605	0	0	1'605 CHF	99.00%	1'588'950.00	0.05	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'930	0	800	1'130 CHF	98.55%	1'113'615.00	0.04	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'320	0	565	1'755 CHF	98.25%	1'724'287.50	0.06	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	1'405	0	1'405	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	7'465	0	2'055	5'410 CHF	96.71%	5'232'011.00	0.17	a)
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	6'600	0	1'730	4'870 CHF	97.56%	4'751'172.00	0.15	a)
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	2'150	0	800	1'350 CHF	99.15%	1'338'525.00	0.04	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	1'240	0	150	1'090 CHF	97.05%	1'057'845.00	0.03	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	7'040	0	0	7'040 CHF	96.36%	6'783'744.00	0.22	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	1'800	0	0	1'800 CHF	97.65%	1'757'700.00	0.06	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	1'390	0	1'390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	5'150	0	1'890	3'260 CHF	97.30%	3'171'980.00	0.10	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	3'810	2'300	955	5'155 CHF	99.84%	5'146'752.00	0.17	a)
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	1'650	0	405	1'245 CHF	99.95%	1'244'377.50	0.04	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	5'800	0	0	5'800 CHF	100.03%	5'801'740.00	0.19	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	3'050	1'000	1'945	2'105 CHF	101.39%	2'134'259.50	0.07	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	400	2'350	810	1'940 CHF	103.30%	2'004'020.00	0.07	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	7'650	0	1'665	5'985 CHF	99.16%	5'934'726.00	0.19	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	8'450	0	8'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	1'110	0	400	710 CHF	99.68%	707'728.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	6'535	0	1'230	5'305 CHF	99.26%	5'265'743.00	0.17	a)
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	1'100	0	0	1'100 CHF	98.50%	1'083'500.00	0.04	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	7'850	0	1'960	5'890 CHF	97.71%	5'755'119.00	0.19	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	5'250	0	1'000	4'250 CHF	99.43%	4'225'775.00	0.14	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	7'000	0	1'060	5'940 CHF	99.41%	5'904'954.00	0.19	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	5'000	0	950	4'050 CHF	99.33%	4'022'865.00	0.13	a)
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	1'500	0	700	800 CHF	98.15%	785'200.00	0.03	a)
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	3'100	0	595	2'505 CHF	98.60%	2'469'930.00	0.08	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	2'820	0	750	2'070 CHF	99.42%	2'057'994.00	0.07	a)
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	4'590	0	0	4'590 CHF	97.94%	4'495'446.00	0.15	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	7'125	0	1'460	5'665 CHF	97.93%	5'547'734.50	0.18	a)
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	2'440	0	215	2'225 CHF	98.15%	2'183'837.50	0.07	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	2'250	0	600	1'650 CHF	98.30%	1'621'950.00	0.05	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	7'280	0	1'315	5'965 CHF	96.99%	5'785'453.50	0.19	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	500	0	0	500 CHF	98.15%	490'750.00	0.02	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	1'350	0	0	1'350 CHF	97.45%	1'315'575.00	0.04	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	5'405	0	1'875	3'530 CHF	98.81%	3'487'993.00	0.11	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	8'550	0	1'025	7'525 CHF	97.34%	7'324'835.00	0.24	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	1'345	0	250	1'095 CHF	99.90%	1'093'905.00	0.04	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	2'055	0	0	2'055 CHF	101.09%	2'077'399.50	0.07	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	7'030	0	810	6'220 CHF	97.68%	6'075'696.00	0.20	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	8'290	0	1'555	6'735 CHF	94.98%	6'396'903.00	0.21	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	8'040	0	1'350	6'690 CHF	98.75%	6'606'375.00	0.22	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	1'400	0	600	800 CHF	100.19%	801'520.00	0.03	a)
CH0310646523	0.5000 % KBFRI 0 1/2 02/23/28	2'300	0	585	1'715 CHF	97.85%	1'678'127.50	0.05	a)
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	1'710	0	300	1'410 CHF	97.35%	1'372'635.00	0.04	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	7'160	0	1'455	5'705 CHF	94.93%	5'415'756.50	0.18	a)
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	1'450	0	0	1'450 CHF	94.55%	1'370'975.00	0.04	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'600	0	550	1'050 CHF	98.84%	1'037'820.00	0.03	a)
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	3'895	0	800	3'095 CHF	94.65%	2'929'417.50	0.10	a)
CH0317921663	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 03/31/28	1'735	200	645	1'290 CHF	97.90%	1'262'910.00	0.04	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	7'955	0	1'135	6'820 CHF	98.14%	6'693'148.00	0.22	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	2'700	0	0	2'700 CHF	98.50%	2'659'500.00	0.09	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	850	0	120	730 CHF	98.50%	719'050.00	0.02	a)
CH0319403777	0.3750 % PPSNSW 0 3/8 04/29/26	1'800	0	300	1'500 CHF	98.50%	1'477'500.00	0.05	a)
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	8'630	0	1'930	6'700 CHF	95.48%	6'397'160.00	0.21	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	8'540	0	2'395	6'145 CHF	96.85%	5'951'432.50	0.19	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	5'200	0	1'550	3'650 CHF	95.58%	3'488'670.00	0.11	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	5'715	0	0	5'715 CHF	94.07%	5'376'100.50	0.18	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	1'200	0	0	1'200 CHF	99.40%	1'192'800.00	0.04	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	2'050	0	0	2'050 CHF	98.90%	2'027'450.00	0.07	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	1'000	0	150	850 CHF	98.15%	834'275.00	0.03	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	2'200	0	250	1'950 CHF	95.35%	1'859'325.00	0.06	a)
CH0319932767	0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31	1'440	0	250	1'190 CHF	95.05%	1'131'095.00	0.04	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0320712604	0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31	1'185	0	300	885 CHF	96.10%	850'485.00	0.03	a)
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	2'130	0	705	1'425 CHF	95.20%	1'356'600.00	0.04	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	6'350	0	965	5'385 CHF	97.41%	5'245'528.50	0.17	a)
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	1'300	0	0	1'300 CHF	95.85%	1'246'050.00	0.04	a)
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	3'600	0	750	2'850 CHF	94.45%	2'691'825.00	0.09	a)
CH0326213953	0.7500 % KISPIZ 0 3/4 07/28/36	1'400	0	650	750 CHF	91.30%	684'750.00	0.02	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	1'100	0	300	800 CHF	99.25%	794'000.00	0.03	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	5'700	0	1'720	3'980 CHF	90.59%	3'605'482.00	0.12	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'445	0	550	1'895 CHF	90.45%	1'714'027.50	0.06	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'700	0	0	2'700 CHF	97.05%	2'620'350.00	0.09	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	6'400	0	0	6'400 CHF	89.46%	5'725'440.00	0.19	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	750	0	250	500 CHF	99.13%	495'650.00	0.02	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	900	0	200	700 CHF	94.50%	661'500.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	1'550	0	0	1'550 CHF	98.45%	1'525'975.00	0.05	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	1'500	0	665	835 CHF	96.50%	805'775.00	0.03	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	2'680	0	0	2'680 CHF	94.29%	2'526'972.00	0.08	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	3'200	0	990	2'210 CHF	88.25%	1'950'325.00	0.06	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	4'200	0	925	3'275 CHF	87.85%	2'877'087.50	0.09	a)
CH0336352775	0.1250 % SCMNFX 0 1/8 09/15/32	2'600	0	650	1'950 CHF	93.30%	1'819'350.00	0.06	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	7'150	0	1'585	5'565 CHF	97.83%	5'444'239.50	0.18	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	7'500	0	1'570	5'930 CHF	94.09%	5'579'537.00	0.18	a)
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	3'200	0	300	2'900 CHF	93.10%	2'699'900.00	0.09	a)
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	2'420	0	700	1'720 CHF	99.14%	1'705'208.00	0.06	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	4'600	0	1'700	2'900 CHF	98.15%	2'846'350.00	0.09	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	4'950	500	1'540	3'910 CHF	93.15%	3'642'165.00	0.12	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	6'960	0	1'815	5'145 CHF	88.91%	4'574'419.50	0.15	a)
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	2'900	0	0	2'900 CHF	98.20%	2'847'800.00	0.09	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	5'150	0	1'030	4'120 CHF	90.66%	3'735'192.00	0.12	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	1'785	0	550	1'235 CHF	96.00%	1'185'600.00	0.04	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	1'400	0	0	1'400 CHF	97.90%	1'370'600.00	0.04	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	2'040	0	640	1'400 CHF	90.65%	1'269'100.00	0.04	a)
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	2'050	0	0	2'050 CHF	91.25%	1'870'625.00	0.06	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	3'000	0	1'000	2'000 CHF	97.80%	1'956'000.00	0.06	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	700	0	100	600 CHF	89.40%	536'400.00	0.02	a)
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	500	0	0	500 CHF	97.70%	488'500.00	0.02	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'500	0	0	1'500 CHF	94.50%	1'417'500.00	0.05	a)
CH0344583783	0.3750 % SCMNFX 0 3/8 12/15/27	1'300	0	0	1'300 CHF	97.85%	1'272'050.00	0.04	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	6'600	0	6'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	2'050	0	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	6'350	0	0	6'350 CHF	97.80%	6'210'300.00	0.20	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	900	0	0	900 CHF	97.35%	876'150.00	0.03	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	700	0	0	700 CHF	97.55%	682'850.00	0.02	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	750	0	150	600 CHF	97.85%	587'100.00	0.02	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	26'683	0	8'053	18'630 CHF	102.10%	19'021'230.00	0.62	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	32'600	0	4'787	27'813 CHF	100.64%	27'991'003.20	0.91	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	30'684	0	7'767	22'917 CHF	100.12%	22'944'500.40	0.75	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	3'500	0	1'395	2'105 CHF	98.91%	2'082'055.50	0.07	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	1'300	0	0	1'300 CHF	98.10%	1'275'300.00	0.04	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	1'705	0	0	1'705 CHF	97.80%	1'667'490.00	0.05	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	8'830	0	8'830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	5'400	0	1'660	3'740 CHF	98.07%	3'667'818.00	0.12	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	5'365	0	975	4'390 CHF	95.05%	4'172'695.00	0.14	a)
CH0350030422	0.7000 % KWOBER 0.7 01/30/26	850	0	150	700 CHF	99.22%	694'540.00	0.02	a)
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	2'100	0	0	2'100 CHF	96.85%	2'033'850.00	0.07	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBNSW 0.2 02/02/26	2'490	0	500	1'990 CHF	98.71%	1'964'329.00	0.06	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	7'000	0	1'420	5'580 CHF	98.36%	5'488'488.00	0.18	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	6'750	0	1'015	5'735 CHF	96.41%	5'529'113.50	0.18	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	3'250	0	935	2'315 CHF	99.01%	2'292'081.50	0.07	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	2'200	0	760	1'440 CHF	97.80%	1'408'320.00	0.05	a)
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	2'900	0	0	2'900 CHF	97.67%	2'832'430.00	0.09	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'000	0	200	800 CHF	97.45%	779'600.00	0.03	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	4'550	0	700	3'850 CHF	98.10%	3'776'850.00	0.12	a)
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	2'450	0	530	1'920 CHF	98.50%	1'891'200.00	0.06	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	2'500	0	1'050	1'450 CHF	99.10%	1'436'950.00	0.05	a)
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	1'100	0	200	900 CHF	98.70%	888'300.00	0.03	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	1'315	0	500	815 CHF	98.80%	805'220.00	0.03	a)
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	6'850	0	1'465	5'385 CHF	98.77%	5'318'764.50	0.17	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	10'400	0	1'790	8'610 CHF	97.72%	8'413'692.00	0.27	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	900	0	150	750 CHF	98.97%	742'275.00	0.02	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	1'500	0	0	1'500 CHF	96.35%	1'445'250.00	0.05	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	3'400	0	600	2'800 CHF	97.65%	2'734'200.00	0.09	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	9'065	400	870	8'595 CHF	98.42%	8'459'199.00	0.28	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	2'450	0	0	2'450 CHF	98.45%	2'412'025.00	0.08	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	3'100	0	100	3'000 CHF	99.25%	2'977'500.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	8'000	0	1'995	6'005 CHF	98.27%	5'901'113.50	0.19	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	3'100	0	600	2'500 CHF	97.75%	2'443'750.00	0.08	a)
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	1'040	0	350	690 CHF	94.10%	649'290.00	0.02	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	5'800	0	1'210	4'590 CHF	98.87%	4'538'133.00	0.15	a)
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'000	0	0	1'000 CHF	96.85%	968'500.00	0.03	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	6'250	0	1'595	4'655 CHF	99.20%	4'617'760.00	0.15	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	1'000	0	0	1'000 CHF	97.80%	978'000.00	0.03	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	1'450	0	605	845 CHF	98.05%	828'522.50	0.03	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	800	0	0	800 CHF	98.75%	790'000.00	0.03	a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	1'000	0	400	600 CHF	95.85%	575'100.00	0.02	a)
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	3'500	0	1'190	2'310 CHF	95.66%	2'209'746.00	0.07	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNXX 0 3/8 05/31/27	2'800	0	650	2'150 CHF	98.30%	2'113'450.00	0.07	a)
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	2'050	0	0	2'050 CHF	95.95%	1'966'975.00	0.06	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	1'510	0	350	1'160 CHF	99.60%	1'155'360.00	0.04	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'750	0	510	1'240 CHF	97.75%	1'212'100.00	0.04	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	1'505	0	500	1'005 CHF	98.50%	989'925.00	0.03	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	800	0	250	550 CHF	99.85%	549'175.00	0.02	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	800	0	0	800 CHF	97.15%	777'200.00	0.03	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	5'300	0	1'345	3'955 CHF	98.62%	3'900'421.00	0.13	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	2'135	0	0	2'135 CHF	94.00%	2'006'900.00	0.07	a)
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	750	0	0	750 CHF	96.95%	727'125.00	0.02	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	1'650	0	400	1'250 CHF	99.12%	1'239'000.00	0.04	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	8'130	0	1'955	6'175 CHF	97.82%	6'040'385.00	0.20	a)
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	950	0	0	950 CHF	97.10%	922'450.00	0.03	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	865	0	0	865 CHF	98.95%	855'917.50	0.03	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNXX 0 3/4 11/24/33	1'950	0	250	1'700 CHF	96.85%	1'646'450.00	0.05	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	8'180	0	1'195	6'985 CHF	97.80%	6'831'330.00	0.22	a)
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	1'250	0	300	950 CHF	99.00%	940'500.00	0.03	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	1'000	0	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.03	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'550	300	1'120	2'730 CHF	97.75%	2'668'575.00	0.09	a)
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	800	0	150	650 CHF	98.05%	637'325.00	0.02	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	8'525	0	1'470	7'055 CHF	98.40%	6'942'120.00	0.23	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	6'600	0	1'200	5'400 CHF	97.05%	5'240'700.00	0.17	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	1'710	0	500	1'210 CHF	98.98%	1'197'658.00	0.04	a)
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	1'400	0	0	1'400 CHF	99.15%	1'388'100.00	0.05	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	2'850	0	2'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	8'870	0	2'900	5'970 CHF	98.20%	5'862'540.00	0.19	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	1'100	0	0	1'100 CHF	99.75%	1'097'250.00	0.04	a)
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	1'200	0	250	950 CHF	98.00%	931'000.00	0.03	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	3'950	0	1'305	2'645 CHF	97.75%	2'585'487.50	0.08	a)
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	7'525	0	1'300	6'225 CHF	97.94%	6'096'765.00	0.20	a)
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	2'405	0	850	1'555 CHF	97.80%	1'520'790.00	0.05	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	1'800	0	760	1'040 CHF	97.65%	1'015'560.00	0.03	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	2'000	0	1'350	650 CHF	98.35%	639'275.00	0.02	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'750	0	800	950 CHF	99.01%	940'595.00	0.03	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	2'200	0	600	1'600 CHF	98.35%	1'573'600.00	0.05	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	1'855	0	500	1'355 CHF	95.40%	1'292'670.00	0.04	a)
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	750	0	0	750 CHF	96.70%	725'250.00	0.02	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	5'540	0	1'020	4'520 CHF	98.75%	4'463'500.00	0.15	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	3'300	0	0	3'300 CHF	97.97%	3'233'010.00	0.11	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	1'650	0	0	1'650 CHF	95.85%	1'581'525.00	0.05	a)
CH0384125123	0.4000 % HILTI 0.4 11/08/27	1'000	0	300	700 CHF	97.95%	685'650.00	0.02	a)
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	2'800	0	650	2'150 CHF	99.49%	2'139'035.00	0.07	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	3'800	0	750	3'050 CHF	98.20%	2'995'100.00	0.10	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	1'800	0	910	890 CHF	97.70%	869'530.00	0.03	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	875	0	175	700 CHF	98.84%	691'880.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	850	0	0	850 CHF	98.00%	833'000.00	0.03	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	2'200	0	600	1'600 CHF	98.50%	1'576'000.00	0.05	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	1'250	0	0	1'250 CHF	98.85%	1'235'625.00	0.04	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	2'135	0	600	1'535 CHF	97.75%	1'500'462.50	0.05	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	6'500	0	900	5'600 CHF	98.91%	5'538'960.00	0.18	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	2'000	0	255	1'745 CHF	97.55%	1'702'247.50	0.06	a)
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	2'500	350	710	2'140 CHF	98.10%	2'099'340.00	0.07	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	1'990	0	1'990	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633336	0.3500 % WKBSNW 0.35 09/07/27	1'500	300	850	950 CHF	97.70%	928'150.00	0.03	a)
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	1'000	0	200	800 CHF	96.95%	775'600.00	0.03	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'365	0	400	965 CHF	98.45%	950'042.50	0.03	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	700	0	0	700 CHF	98.55%	689'850.00	0.02	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	800	0	0	800 CHF	96.75%	774'000.00	0.03	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	1'750	0	0	1'750 CHF	98.76%	1'728'300.00	0.06	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	5'650	0	1'310	4'340 CHF	97.91%	4'249'294.00	0.14	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'950	0	500	1'450 CHF	99.44%	1'441'880.00	0.05	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	1'410	0	250	1'160 CHF	100.20%	1'162'320.00	0.04	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	1'710	0	500	1'210 CHF	99.80%	1'207'580.00	0.04	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	8'650	0	2'280	6'370 CHF	98.64%	6'283'368.00	0.20	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	600	0	0	600 CHF	98.70%	592'200.00	0.02	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	1'200	0	0	1'200 CHF	99.60%	1'195'200.00	0.04	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'400	0	685	1'715 CHF	97.95%	1'679'842.50	0.05	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	1'150	0	0	1'150 CHF	98.60%	1'133'900.00	0.04	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	2'100	0	0	2'100 CHF	94.85%	1'991'850.00	0.06	a)
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'020	0	0	1'020 CHF	97.70%	996'540.00	0.03	a)
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	1'850	0	550	1'300 CHF	98.75%	1'283'750.00	0.04	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	4'900	0	1'000	3'900 CHF	98.30%	3'833'700.00	0.13	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	750	0	0	750 CHF	101.85%	763'875.00	0.02	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'350	0	600	750 CHF	98.25%	736'875.00	0.02	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	1'800	0	0	1'800 CHF	98.00%	1'764'000.00	0.06	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	900	0	0	900 CHF	99.25%	893'250.00	0.03	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	2'100	0	700	1'400 CHF	99.00%	1'386'000.00	0.05	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	1'000	0	300	700 CHF	98.15%	687'050.00	0.02	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	1'885	0	0	1'885 CHF	98.20%	1'851'070.00	0.06	a)
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	1'425	0	450	975 CHF	97.00%	945'750.00	0.03	a)
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	1'350	0	520	830 CHF	96.30%	799'290.00	0.03	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	2'650	0	535	2'115 CHF	97.80%	2'068'470.00	0.07	a)
CH0419040735	0.3000 % WKBSNW 0.3 02/01/27	1'315	0	0	1'315 CHF	98.00%	1'288'700.00	0.04	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	1'800	0	565	1'235 CHF	98.55%	1'217'092.50	0.04	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	2'900	0	900	2'000 CHF	97.70%	1'954'000.00	0.06	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	1'830	0	300	1'530 CHF	99.20%	1'517'760.00	0.05	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	1'000	0	400	600 CHF	97.20%	583'200.00	0.02	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	8'800	0	2'090	6'710 CHF	97.31%	6'529'501.00	0.21	a)
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	700	0	0	700 CHF	97.55%	682'850.00	0.02	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	500	0	0	500 CHF	101.55%	507'750.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	9'900	0	3'180	6'720 CHF	97.11%	6'525'792.00	0.21	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	3'950	0	500	3'450 CHF	95.25%	3'286'125.00	0.11	a)
CH0419040974	0.8500 % KBLUZE 0.85 03/12/42	1'700	0	400	1'300 CHF	95.70%	1'244'100.00	0.04	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMNXX 0 1/2 03/15/29	1'800	200	600	1'400 CHF	97.75%	1'368'500.00	0.04	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	2'800	200	500	2'500 CHF	99.85%	2'496'250.00	0.08	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'100	0	800	1'300 CHF	97.75%	1'270'750.00	0.04	a)
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	970	0	250	720 CHF	98.25%	707'400.00	0.02	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'050	0	595	455 CHF	98.85%	449'767.50	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	825	0	200	625 CHF	99.35%	620'937.50	0.02	a)
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	1'300	0	250	1'050 CHF	98.40%	1'033'200.00	0.03	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	1'200	0	300	900 CHF	97.60%	878'400.00	0.03	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'400	0	1'000	2'400 CHF	96.25%	2'310'000.00	0.08	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	1'000	0	0	1'000 CHF	95.80%	958'000.00	0.03	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	2'050	0	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	6'100	0	1'140	4'960 CHF	96.38%	4'780'448.00	0.16	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	3'200	0	0	3'200 CHF	94.94%	3'038'080.00	0.10	a)
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	1'300	0	250	1'050 CHF	98.25%	1'031'625.00	0.03	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	970	0	0	970 CHF	95.45%	925'865.00	0.03	a)
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	1'350	0	610	740 CHF	97.50%	721'500.00	0.02	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	1'800	0	500	1'300 CHF	95.70%	1'244'100.00	0.04	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	4'365	0	1'000	3'365 CHF	98.15%	3'302'747.50	0.11	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	700	350	0	1'050 CHF	91.60%	961'800.00	0.03	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'600	0	0	2'600 CHF	94.50%	2'457'000.00	0.08	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	1'550	0	300	1'250 CHF	97.10%	1'213'750.00	0.04	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	1'100	0	300	800 CHF	97.10%	776'800.00	0.03	a)
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	1'200	0	0	1'200 CHF	90.65%	1'087'800.00	0.04	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	2'400	0	600	1'800 CHF	89.70%	1'614'600.00	0.05	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	600	0	0	600 CHF	89.90%	539'400.00	0.02	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	800	0	400	400 CHF	95.00%	380'000.00	0.01	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	2'500	0	670	1'830 CHF	87.10%	1'593'930.00	0.05	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'200	0	250	950 CHF	82.25%	781'375.00	0.03	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	1'680	0	300	1'380 CHF	95.40%	1'316'520.00	0.04	a)
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	1'100	0	300	800 CHF	75.85%	606'800.00	0.02	a)
CH0419041527	0.0000 % LLBSW 0 09/27/29	1'000	0	575	425 CHF	94.20%	400'350.00	0.01	a)
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	1'300	0	0	1'300 CHF	83.25%	1'082'250.00	0.04	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	2'900	0	400	2'500 CHF	84.95%	2'123'750.00	0.07	a)
CH0419041592	0.0000 % SOONVX 0 10/11/29	1'000	0	0	1'000 CHF	94.65%	946'500.00	0.03	a)
CH0419041600	0.4000 % SOONVX 0.4 10/11/34	1'365	0	700	665 CHF	93.05%	618'782.50	0.02	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKKB 0 11/05/29	900	0	400	500 CHF	94.65%	473'250.00	0.02	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'600	0	300	1'300 CHF	97.60%	1'268'800.00	0.04	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	1'650	0	485	1'165 CHF	98.67%	1'149'505.50	0.04	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	600	0	0	600 CHF	99.30%	595'800.00	0.02	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	5'000	0	800	4'200 CHF	99.05%	4'160'100.00	0.14	a)
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	6'850	0	1'265	5'585 CHF	99.21%	5'540'878.50	0.18	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	7'750	0	2'000	5'750 CHF	98.12%	5'641'900.00	0.18	a)
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	1'150	0	455	695 CHF	100.30%	697'085.00	0.02	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	9'020	0	3'445	5'575 CHF	97.90%	5'457'925.00	0.18	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'400	0	0	2'400 CHF	99.54%	2'388'960.00	0.08	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	915	0	300	615 CHF	99.45%	611'617.50	0.02	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	4'200	0	1'900	2'300 CHF	99.28%	2'283'440.00	0.07	a)
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	3'300	0	0	3'300 CHF	98.60%	3'253'800.00	0.11	a)
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'000	0	200	800 CHF	99.14%	793'120.00	0.03	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	4'640	0	1'230	3'410 CHF	98.76%	3'367'716.00	0.11	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	2'950	0	0	2'950 CHF	102.72%	3'030'240.00	0.10	a)
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	800	0	250	550 CHF	102.95%	566'225.00	0.02	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	2'100	0	800	1'300 CHF	99.63%	1'295'190.00	0.04	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	1'350	0	0	1'350 CHF	98.80%	1'333'800.00	0.04	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	7'110	0	2'035	5'075 CHF	103.00%	5'227'250.00	0.17	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	26'550	2'300	6'520	22'330 CHF	95.57%	21'340'781.00	0.70	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	28'699	0	6'521	22'178 CHF	93.28%	20'687'638.40	0.67	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	17'900	0	4'279	13'621 CHF	114.25%	15'561'992.50	0.51	a)
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	600	0	0	600 CHF	98.85%	593'100.00	0.02	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	5'655	0	1'350	4'305 CHF	98.54%	4'242'147.00	0.14	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	1'850	0	200	1'650 CHF	98.75%	1'629'375.00	0.05	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	1'500	0	0	1'500 CHF	98.25%	1'473'750.00	0.05	a)
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'710	0	0	1'710 CHF	98.80%	1'689'480.00	0.06	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	600	0	0	600 CHF	98.45%	590'700.00	0.02	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	800	0	200	600 CHF	100.95%	605'700.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	5'200	0	1'125	4'075 CHF	98.53%	4'015'097.50	0.13	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	600	0	0	600 CHF	100.90%	605'400.00	0.02	a)
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	1'450	0	300	1'150 CHF	99.25%	1'141'375.00	0.04	a)
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	2'200	0	0	2'200 CHF	97.70%	2'149'400.00	0.07	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	1'800	0	700	1'100 CHF	99.19%	1'091'090.00	0.04	a)
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	1'400	0	865	535 CHF	98.65%	527'777.50	0.02	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	1'200	0	0	1'200 CHF	97.15%	1'165'800.00	0.04	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	4'800	0	960	3'840 CHF	97.65%	3'749'760.00	0.12	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	2'600	0	1'000	1'600 CHF	98.10%	1'569'600.00	0.05	a)
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	1'600	0	600	1'000 CHF	95.00%	950'000.00	0.03	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	2'100	0	300	1'800 CHF	92.30%	1'661'400.00	0.05	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	1'300	0	300	1'000 CHF	96.85%	968'500.00	0.03	a)
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	1'920	0	550	1'370 CHF	96.95%	1'328'215.00	0.04	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	8'100	0	1'255	6'845 CHF	93.67%	6'411'711.50	0.21	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	2'670	0	600	2'070 CHF	89.60%	1'854'720.00	0.06	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'500	0	730	770 CHF	90.50%	696'850.00	0.02	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	2'650	0	0	2'650 CHF	93.90%	2'488'350.00	0.08	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	1'500	0	310	1'190 CHF	95.30%	1'134'070.00	0.04	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	3'400	0	755	2'645 CHF	93.60%	2'475'720.00	0.08	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	1'000	0	0	1'000 CHF	96.00%	960'000.00	0.03	a)
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	1'500	0	0	1'500 CHF	92.90%	1'393'500.00	0.05	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	6'020	0	800	5'220 CHF	93.59%	4'885'398.00	0.16	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	1'300	0	400	900 CHF	97.30%	875'700.00	0.03	a)
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	2'795	0	0	2'795 CHF	97.18%	2'716'181.00	0.09	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	1'435	0	600	835 CHF	99.45%	830'407.50	0.03	a)
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'500	0	600	900 CHF	96.45%	868'050.00	0.03	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	1'200	0	0	1'200 CHF	99.65%	1'195'800.00	0.04	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	6'650	0	1'150	5'500 CHF	96.13%	5'287'150.00	0.17	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	6'150	0	0	6'150 CHF	96.33%	5'924'295.00	0.19	a)
CH0477380916	0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29	1'500	0	0	1'500 CHF	96.25%	1'443'750.00	0.05	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	1'135	0	1'135	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	2'000	0	200	1'800 CHF	94.90%	1'708'200.00	0.06	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	3'770	0	630	3'140 CHF	94.85%	2'978'290.00	0.10	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	4'500	500	1'035	3'965 CHF	91.50%	3'627'975.00	0.12	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	1'000	0	300	700 CHF	95.70%	669'900.00	0.02	a)
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	1'500	0	770	730 CHF	94.85%	692'405.00	0.02	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	1'810	0	0	1'810 CHF	94.60%	1'712'260.00	0.06	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	1'400	0	200	1'200 CHF	96.50%	1'158'000.00	0.04	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	2'800	0	0	2'800 CHF	91.95%	2'574'600.00	0.08	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	5'600	0	2'375	3'225 CHF	97.46%	3'143'085.00	0.10	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	6'950	0	0	6'950 CHF	92.80%	6'449'600.00	0.21	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	1'500	0	0	1'500 CHF	91.18%	1'367'700.00	0.04	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	8'165	0	3'550	4'615 CHF	78.25%	3'611'237.50	0.12	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	900	0	300	600 CHF	94.60%	567'600.00	0.02	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	1'650	0	200	1'450 CHF	82.10%	1'190'450.00	0.04	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	2'250	0	615	1'635 CHF	97.60%	1'595'760.00	0.05	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	1'600	0	680	920 CHF	97.65%	898'380.00	0.03	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	1'200	0	0	1'200 CHF	92.85%	1'114'200.00	0.04	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	2'130	0	890	1'240 CHF	97.50%	1'209'000.00	0.04	a)
CH0488506665	0.0000 % PSPNSW 0 02/06/30	1'200	0	770	430 CHF	93.15%	400'545.00	0.01	a)
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	1'900	0	0	1'900 CHF	92.60%	1'759'400.00	0.06	a)
CH0494734335	0.0000 % SCMNVX 0 08/30/44	1'055	0	0	1'055 CHF	75.50%	796'525.00	0.03	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'750	0	0	1'750 CHF	76.95%	1'346'625.00	0.04	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	900	0	250	650 CHF	76.70%	498'550.00	0.02	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	460	0	0	460 CHF	98.32%	452'272.00	0.01	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	900	0	0	900 CHF	97.65%	878'850.00	0.03	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	900	0	0	900 CHF	94.40%	849'600.00	0.03	a)
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	1'200	0	350	850 CHF	83.20%	707'200.00	0.02	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	4'900	0	1'130	3'770 CHF	98.60%	3'717'220.00	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	2'000	0	650	1'350 CHF	98.75%	1'333'125.00	0.04	a)
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	94.90%	1'328'600.00	0.04	a)
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	1'420	0	0	1'420 CHF	97.00%	1'377'400.00	0.04	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	1'900	0	0	1'900 CHF	94.65%	1'798'350.00	0.06	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	1'300	0	0	1'300 CHF	91.60%	1'190'800.00	0.04	a)
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	2'100	0	675	1'425 CHF	94.40%	1'345'200.00	0.04	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRI 0 02/26/30	2'030	0	800	1'230 CHF	94.25%	1'159'275.00	0.04	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	2'500	0	500	2'000 CHF	96.10%	1'922'000.00	0.06	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	6'580	0	1'980	4'600 CHF	93.85%	4'317'100.00	0.14	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'700	0	0	2'700 CHF	85.25%	2'301'750.00	0.08	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	560	0	0	560 CHF	95.80%	536'480.00	0.02	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	2'500	0	800	1'700 CHF	96.05%	1'632'850.00	0.05	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	1'800	0	0	1'800 CHF	94.15%	1'694'700.00	0.06	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	1'000	0	0	1'000 CHF	95.05%	950'500.00	0.03	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRI 0.14 06/12/30	1'500	0	555	945 CHF	94.60%	893'970.00	0.03	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	720	0	0	720 CHF	96.10%	691'920.00	0.02	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	1'100	0	665	435 CHF	95.65%	416'077.50	0.01	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	3'165	650	1'300	2'515 CHF	92.20%	2'318'830.00	0.08	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRI 0 02/05/31	2'100	0	0	2'100 CHF	92.85%	1'949'850.00	0.06	a)
CH0506071361	0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31	1'100	0	0	1'100 CHF	92.90%	1'021'900.00	0.03	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	2'300	0	400	1'900 CHF	98.64%	1'874'160.00	0.06	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'500	0	695	805 CHF	91.20%	734'160.00	0.02	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	3'835	0	0	3'835 CHF	93.97%	3'603'749.50	0.12	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	1'090	0	0	1'090 CHF	91.05%	992'445.00	0.03	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	1'700	0	0	1'700 CHF	95.20%	1'618'400.00	0.05	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	3'100	0	895	2'205 CHF	97.63%	2'152'741.50	0.07	a)
CH0515152467	0.1300 % SCMNVX 0.13 09/18/31	700	0	0	700 CHF	93.95%	657'650.00	0.02	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	900	0	0	900 CHF	91.45%	823'050.00	0.03	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	1'000	0	0	1'000 CHF	95.15%	951'500.00	0.03	a)
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	1'400	0	0	1'400 CHF	98.50%	1'379'000.00	0.04	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	2'870	0	600	2'270 CHF	93.10%	2'113'370.00	0.07	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	850	0	150	700 CHF	91.85%	642'950.00	0.02	a)
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	3'215	0	300	2'915 CHF	90.40%	2'635'160.00	0.09	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBSW 0 02/14/29	1'500	0	700	800 CHF	95.10%	760'800.00	0.02	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	3'400	0	800	2'600 CHF	91.10%	2'368'600.00	0.08	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	2'700	0	0	2'700 CHF	91.40%	2'467'800.00	0.08	a)
CH0522158861	0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36	1'305	0	100	1'205 CHF	90.50%	1'090'525.00	0.04	a)
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	1'625	0	625	1'000 CHF	92.80%	928'000.00	0.03	a)
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	735	0	0	735 CHF	94.85%	697'147.50	0.02	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	1'800	0	350	1'450 CHF	93.75%	1'359'375.00	0.04	a)
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	900	0	0	900 CHF	94.25%	848'250.00	0.03	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	1'100	0	100	1'000 CHF	91.10%	911'000.00	0.03	a)
CH0522158960	0.3126 % KBFRI 0.3126 02/02/32	1'680	0	920	760 CHF	94.50%	718'200.00	0.02	a)
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	2'500	0	0	2'500 CHF	94.70%	2'367'500.00	0.08	a)
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	2'050	0	0	2'050 CHF	95.85%	1'964'925.00	0.06	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	1'800	0	350	1'450 CHF	98.10%	1'422'450.00	0.05	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	1'400	0	0	1'400 CHF	108.70%	1'521'800.00	0.05	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	2'000	450	300	2'150 CHF	110.35%	2'372'525.00	0.08	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	1'800	0	0	1'800 CHF	103.40%	1'861'200.00	0.06	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	2'200	0	0	2'200 CHF	102.10%	2'246'200.00	0.07	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	2'100	0	300	1'800 CHF	91.85%	1'653'300.00	0.05	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	6'540	0	1'210	5'330 CHF	96.83%	5'161'039.00	0.17	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	2'900	0	0	2'900 CHF	81.20%	2'354'800.00	0.08	a)
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	1'070	0	150	920 CHF	98.30%	904'360.00	0.03	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	4'060	0	0	4'060 CHF	94.89%	3'852'534.00	0.13	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	2'690	0	950	1'740 CHF	98.05%	1'706'070.00	0.06	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	2'850	0	580	2'270 CHF	99.60%	2'260'920.00	0.07	a)
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	6'400	0	1'540	4'860 CHF	93.70%	4'553'820.00	0.15	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	2'525	0	0	2'525 CHF	86.65%	2'187'912.50	0.07	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	3'235	0	720	2'515 CHF	97.15%	2'443'322.50	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	3'245	0	950	2'295 CHF	86.90%	1'994'355.00	0.07	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	3'700	0	1'585	2'115 CHF	95.04%	2'010'096.00	0.07	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0.1/4 06/12/40 522	1'860	0	860	1'000 CHF	88.30%	883'000.00	0.03	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	1'400	0	545	855 CHF	99.20%	848'160.00	0.03	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	5'380	0	1'140	4'240 CHF	91.20%	3'866'880.00	0.13	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	4'950	0	1'635	3'315 CHF	96.55%	3'200'632.50	0.10	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	3'995	0	1'440	2'555 CHF	90.30%	2'307'165.00	0.08	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	1'980	0	600	1'380 CHF	98.10%	1'353'780.00	0.04	a)
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'300	0	250	1'050 CHF	92.65%	972'825.00	0.03	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	1'695	0	600	1'095 CHF	97.15%	1'063'792.50	0.03	a)
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	1'360	0	650	710 CHF	90.55%	642'905.00	0.02	a)
CH0536893362	0.1500 % WKBSW 0.15 10/05/32	1'350	0	0	1'350 CHF	91.75%	1'238'625.00	0.04	a)
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	5'370	0	1'995	3'375 CHF	94.51%	3'189'712.50	0.10	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	1'300	0	300	1'000 CHF	83.30%	833'000.00	0.03	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	900	0	200	700 CHF	93.30%	653'100.00	0.02	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	1'800	0	500	1'300 CHF	90.25%	1'173'250.00	0.04	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	4'320	0	1'435	2'885 CHF	97.68%	2'818'068.00	0.09	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	1'800	1'000	1'085	1'715 CHF	91.56%	1'570'254.00	0.05	a)
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.05%	980'500.00	0.03	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	5'325	0	0	5'325 CHF	97.03%	5'166'847.50	0.17	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	2'200	0	650	1'550 CHF	99.80%	1'546'900.00	0.05	a)
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	2'100	0	400	1'700 CHF	100.00%	1'700'000.00	0.06	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	2'100	400	0	2'500 CHF	96.30%	2'407'500.00	0.08	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	2'500	0	1'000	1'500 CHF	90.20%	1'353'000.00	0.04	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	2'100	0	850	1'250 CHF	99.35%	1'241'875.00	0.04	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	2'710	0	200	2'510 CHF	98.35%	2'468'585.00	0.08	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	3'500	0	1'020	2'480 CHF	96.80%	2'400'640.00	0.08	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	900	0	250	650 CHF	95.95%	623'675.00	0.02	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	700	0	0	700 CHF	92.05%	644'350.00	0.02	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	4'650	0	1'520	3'130 CHF	86.76%	2'715'588.00	0.09	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'500	0	200	1'300 CHF	99.27%	1'290'510.00	0.04	a)
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	1'200	0	410	790 CHF	88.50%	699'150.00	0.02	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	1'650	0	100	1'550 CHF	98.15%	1'521'325.00	0.05	a)
CH0553331825	0.5000 % BALHOL 0 1/2 12/16/30	1'070	0	0	1'070 CHF	95.50%	1'021'850.00	0.03	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	600	0	0	600 CHF	81.95%	491'700.00	0.02	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'265	0	1'225	4'040 CHF	95.19%	3'845'676.00	0.13	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	4'350	0	0	4'350 CHF	87.31%	3'797'985.00	0.12	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	930	0	200	730 CHF	98.00%	715'400.00	0.02	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	19'370	2'100	4'737	16'733 CHF	97.84%	16'371'567.20	0.53	a)
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	16'200	3'000	4'688	14'512 CHF	113.96%	16'537'875.20	0.54	a)
CH0557778963	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33 MAR	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778989	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 APR	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778997	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 APR	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779003	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47	0	9'900	3'665	6'235 CHF	108.80%	6'783'680.00	0.22	a)
CH0557779011	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 10JU	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779029	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 19JU	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779037	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 5JL	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779045	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47 22JU	0	2'700	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	2'100	0	0	2'100 CHF	99.14%	2'081'940.00	0.07	a)
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	2'000	0	810	1'190 CHF	74.85%	890'715.00	0.03	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	4'485	0	1'315	3'170 CHF	86.02%	2'726'834.00	0.09	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	1'460	0	0	1'460 CHF	94.40%	1'378'240.00	0.04	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	1'180	0	250	930 CHF	98.30%	914'190.00	0.03	a)
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	1'750	0	0	1'750 CHF	96.00%	1'680'000.00	0.05	a)
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	2'105	0	500	1'605 CHF	93.50%	1'500'675.00	0.05	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	1'975	0	400	1'575 CHF	87.20%	1'373'400.00	0.04	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	1'600	0	600	1'000 CHF	93.35%	933'500.00	0.03	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	590	0	100	490 CHF	86.80%	425'320.00	0.01	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	2'700	0	605	2'095 CHF	95.55%	2'001'772.50	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	1'705	0	650	1'055 CHF	92.80%	979'040.00	0.03	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	1'700	0	0	1'700 CHF	93.05%	1'581'850.00	0.05	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'100	200	0	1'300 CHF	97.95%	1'273'350.00	0.04	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'260	0	545	715 CHF	91.75%	656'012.50	0.02	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	8'080	0	1'790	6'290 CHF	94.83%	5'964'807.00	0.19	a)
CH0570576279	0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36	900	0	0	900 CHF	88.10%	792'900.00	0.03	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	900	0	200	700 CHF	90.90%	636'300.00	0.02	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	1'900	300	150	2'050 CHF	96.85%	1'985'425.00	0.06	a)
CH0572142484	0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN	2'100	0	500	1'600 CHF	94.05%	1'504'800.00	0.05	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	2'400	0	1'370	1'030 CHF	92.18%	949'454.00	0.03	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	850	0	0	850 CHF	96.25%	818'125.00	0.03	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'800	0	500	1'300 CHF	96.35%	1'252'550.00	0.04	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	6'785	0	1'160	5'625 CHF	95.24%	5'357'250.00	0.17	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	6'600	0	1'690	4'910 CHF	92.96%	4'564'336.00	0.15	a)
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	1'000	0	400	600 CHF	77.60%	465'600.00	0.02	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	1'705	0	350	1'355 CHF	98.00%	1'327'900.00	0.04	a)
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	835	0	150	685 CHF	93.30%	639'105.00	0.02	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	1'320	0	200	1'120 CHF	72.40%	810'880.00	0.03	a)
CH0580291968	0.2450 % SCMNVX 0.245 11/20/34	1'000	250	550	700 CHF	91.55%	640'850.00	0.02	a)
CH0580464698	1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34	900	0	100	800 CHF	98.30%	786'400.00	0.03	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'830	0	200	2'630 CHF	95.75%	2'518'225.00	0.08	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	2'625	0	0	2'625 CHF	97.00%	2'546'250.00	0.08	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	3'350	0	555	2'795 CHF	91.10%	2'546'245.00	0.08	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	6'900	0	1'260	5'640 CHF	95.95%	5'411'580.00	0.18	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	4'400	0	1'910	2'490 CHF	91.51%	2'278'599.00	0.07	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	7'125	0	960	6'165 CHF	88.55%	5'459'107.50	0.18	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	4'600	0	1'405	3'195 CHF	93.84%	2'998'188.00	0.10	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	1'020	1'000	955	1'065 CHF	90.77%	966'700.50	0.03	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	600	0	0	600 CHF	97.55%	585'300.00	0.02	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	2'300	200	900	1'600 CHF	93.90%	1'502'400.00	0.05	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	3'400	0	1'330	2'070 CHF	83.75%	1'733'625.00	0.06	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	900	0	0	900 CHF	97.40%	876'600.00	0.03	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	1'300	0	590	710 CHF	90.25%	640'775.00	0.02	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	1'150	0	0	1'150 CHF	90.90%	1'045'350.00	0.03	a)
CH0593093211	0.1250 % KWOPER 0 1/8 02/21/31	900	0	400	500 CHF	93.20%	466'000.00	0.02	a)
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	2'145	200	350	1'995 CHF	93.20%	1'859'340.00	0.06	a)
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	2'800	0	0	2'800 CHF	92.67%	2'594'760.00	0.08	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	1'000	0	0	1'000 CHF	87.41%	874'100.00	0.03	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	1'550	0	300	1'250 CHF	97.10%	1'213'750.00	0.04	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	3'400	0	800	2'600 CHF	94.85%	2'466'100.00	0.08	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	8'170	0	1'685	6'485 CHF	94.61%	6'135'458.50	0.20	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	1'800	0	735	1'065 CHF	93.20%	992'580.00	0.03	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	2'080	0	1'100	980 CHF	98.75%	967'750.00	0.03	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	2'600	0	505	2'095 CHF	94.15%	1'972'442.50	0.06	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	1'800	0	900	900 CHF	91.00%	819'000.00	0.03	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	9'040	0	2'165	6'875 CHF	96.84%	6'657'750.00	0.22	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	1'200	0	0	1'200 CHF	93.19%	1'118'280.00	0.04	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	4'000	500	1'225	3'275 CHF	91.15%	2'985'162.50	0.10	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	2'310	0	605	1'705 CHF	95.75%	1'632'537.50	0.05	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	800	0	0	800 CHF	97.25%	778'000.00	0.03	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	3'800	0	750	3'050 CHF	93.10%	2'839'550.00	0.09	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	2'600	0	940	1'660 CHF	93.90%	1'558'740.00	0.05	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	2'540	0	0	2'540 CHF	97.85%	2'485'390.00	0.08	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	1'200	0	0	1'200 CHF	94.80%	1'137'600.00	0.04	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	1'200	0	0	1'200 CHF	96.50%	1'158'000.00	0.04	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	840	0	150	690 CHF	98.30%	678'270.00	0.02	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	8'175	0	2'090	6'085 CHF	94.35%	5'741'197.50	0.19	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	3'125	0	1'475	1'650 CHF	91.10%	1'503'150.00	0.05	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	2'900	0	805	2'095 CHF	89.53%	1'875'653.50	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	1'400	0	0	1'400 CHF	93.30%	1'306'200.00	0.04	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31	2'420	0	750	1'670 CHF	93.05%	1'553'935.00	0.05	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	1'400	0	400	1'000 CHF	96.00%	960'000.00	0.03	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'000	0	300	700 CHF	98.50%	689'500.00	0.02	a)
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	2'200	0	1'470	730 CHF	95.20%	694'960.00	0.02	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	1'360	0	300	1'060 CHF	96.30%	1'020'780.00	0.03	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	3'565	0	1'000	2'565 CHF	95.65%	2'453'422.50	0.08	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVS 0 1/4 05/18/33	1'000	0	585	415 CHF	93.15%	386'572.50	0.01	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	2'105	0	0	2'105 CHF	98.25%	2'068'162.50	0.07	a)
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	1'530	0	0	1'530 CHF	95.25%	1'457'325.00	0.05	a)
CH1112940601	0.0500 % NIDKKB 0.05 05/27/31	1'385	0	350	1'035 CHF	92.75%	959'962.50	0.03	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	2'200	0	585	1'615 CHF	92.50%	1'493'875.00	0.05	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	1'605	0	0	1'605 CHF	93.10%	1'494'255.00	0.05	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	1'500	70	0	1'570 CHF	98.00%	1'538'600.00	0.05	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	2'245	0	620	1'625 CHF	95.10%	1'545'375.00	0.05	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	1'230	0	200	1'030 CHF	96.00%	988'800.00	0.03	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'020	0	150	870 CHF	92.35%	803'445.00	0.03	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	4'300	0	895	3'405 CHF	93.18%	3'172'779.00	0.10	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	1'105	0	250	855 CHF	90.00%	769'500.00	0.03	a)
CH1118223499	0.3000 % KSSTGA 0.3 09/30/36	1'710	0	670	1'040 CHF	85.00%	884'000.00	0.03	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	1'700	0	0	1'700 CHF	89.05%	1'513'850.00	0.05	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'500	0	300	1'200 CHF	92.55%	1'110'600.00	0.04	a)
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483754	0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN	1'600	0	400	1'200 CHF	93.65%	1'123'800.00	0.04	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	2'135	0	500	1'635 CHF	97.08%	1'587'258.00	0.05	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	3'000	0	0	3'000 CHF	87.50%	2'625'000.00	0.09	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'400	0	1'425	975 CHF	86.05%	838'987.50	0.03	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	1'100	0	0	1'100 CHF	96.65%	1'063'150.00	0.03	a)
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	1'600	0	300	1'300 CHF	94.10%	1'223'300.00	0.04	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	1'000	0	150	850 CHF	93.75%	796'875.00	0.03	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33	2'115	0	450	1'665 CHF	90.45%	1'505'992.50	0.05	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	700	0	0	700 CHF	90.60%	634'200.00	0.02	a)
CH1129053828	0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40	845	0	170	675 CHF	85.40%	576'450.00	0.02	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	900	0	495	405 CHF	90.10%	364'905.00	0.01	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	950	0	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'675	0	0	1'675 CHF	94.05%	1'575'337.50	0.05	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	7'025	0	1'500	5'525 CHF	93.29%	5'154'272.50	0.17	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	1'710	0	0	1'710 CHF	87.95%	1'503'945.00	0.05	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	360	0	0	360 CHF	98.40%	354'240.00	0.01	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	1'055	0	0	1'055 CHF	84.80%	894'640.00	0.03	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	1'575	0	525	1'050 CHF	98.10%	1'030'050.00	0.03	a)
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	905	0	0	905 CHF	92.10%	833'505.00	0.03	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	710	0	300	410 CHF	91.40%	374'740.00	0.01	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	700	0	0	700 CHF	94.65%	662'550.00	0.02	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	1'500	0	0	1'500 CHF	93.50%	1'402'500.00	0.05	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	1'000	0	0	1'000 CHF	91.40%	914'000.00	0.03	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	1'285	0	0	1'285 CHF	92.60%	1'189'910.00	0.04	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	3'675	0	0	3'675 CHF	94.20%	3'461'850.00	0.11	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	2'700	0	0	2'700 CHF	91.02%	2'457'540.00	0.08	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	3'850	180	945	3'085 CHF	94.60%	2'918'410.00	0.10	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	1'510	0	350	1'160 CHF	93.35%	1'082'860.00	0.04	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	2'180	0	400	1'780 CHF	98.67%	1'756'326.00	0.06	a)
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	855	0	350	505 CHF	95.90%	484'295.00	0.02	a)
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	2'000	0	930	1'070 CHF	93.25%	997'775.00	0.03	a)
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	1'000	0	430	570 CHF	98.20%	559'740.00	0.02	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	1'770	0	685	1'085 CHF	96.30%	1'044'855.00	0.03	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	1'300	0	500	800 CHF	85.60%	684'800.00	0.02	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	1'710	0	700	1'010 CHF	92.85%	937'785.00	0.03	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	2'190	0	2'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	900	0	520	380 CHF	95.20%	361'760.00	0.01	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	2'900	0	650	2'250 CHF	97.50%	2'193'750.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	1'000	0	300	700 CHF	86.30%	604'100.00	0.02	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	3'650	0	0	3'650 CHF	94.57%	3'451'805.00	0.11	a)
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	1'900	0	900	1'000 CHF	97.80%	978'000.00	0.03	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	4'000	0	800	3'200 CHF	96.75%	3'096'000.00	0.10	a)
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	900	0	0	900 CHF	94.65%	851'850.00	0.03	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	1'045	0	0	1'045 CHF	96.66%	1'010'097.00	0.03	a)
CH1148266245	0.3000 % WKBNSW 0.3 02/07/30	1'200	0	250	950 CHF	95.45%	906'775.00	0.03	a)
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	1'200	0	0	1'200 CHF	95.35%	1'144'200.00	0.04	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	1'700	0	700	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.03	a)
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	990	0	0	990 CHF	96.35%	953'865.00	0.03	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	5'275	0	1'765	3'510 CHF	94.25%	3'308'175.00	0.11	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	3'250	0	805	2'445 CHF	95.10%	2'325'195.00	0.08	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'500	0	0	1'500 CHF	94.15%	1'412'250.00	0.05	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	1'700	0	0	1'700 CHF	95.05%	1'615'850.00	0.05	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	1'500	0	0	1'500 CHF	90.55%	1'358'250.00	0.04	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	1'050	0	150	900 CHF	96.45%	868'050.00	0.03	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	1'700	0	0	1'700 CHF	98.00%	1'666'000.00	0.05	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	4'000	0	870	3'130 CHF	98.34%	3'078'042.00	0.10	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	3'900	0	990	2'910 CHF	97.63%	2'841'033.00	0.09	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	1'400	0	0	1'400 CHF	96.50%	1'351'000.00	0.04	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	1'550	0	550	1'000 CHF	93.35%	933'500.00	0.03	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	7'850	0	1'430	6'420 CHF	93.87%	6'026'454.00	0.20	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	1'545	0	0	1'545 CHF	96.46%	1'490'307.00	0.05	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'500	0	1'470	1'030 CHF	91.80%	945'540.00	0.03	a)
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	3'270	0	400	2'870 CHF	98.40%	2'824'080.00	0.09	a)
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	1'000	0	0	1'000 CHF	96.95%	969'500.00	0.03	a)
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	900	0	0	900 CHF	96.00%	864'000.00	0.03	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	1'940	0	0	1'940 CHF	98.35%	1'907'990.00	0.06	a)
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	1'050	0	0	1'050 CHF	96.25%	1'010'625.00	0.03	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	1'800	0	300	1'500 CHF	98.44%	1'476'600.00	0.05	a)
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	1'700	0	0	1'700 CHF	97.70%	1'660'900.00	0.05	a)
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	1'600	0	250	1'350 CHF	97.65%	1'318'275.00	0.04	a)
CH1164800661	0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29	1'200	150	500	850 CHF	96.85%	823'225.00	0.03	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	7'620	0	1'900	5'720 CHF	98.95%	5'659'940.00	0.18	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	5'150	0	0	5'150 CHF	98.20%	5'057'300.00	0.16	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	2'560	0	0	2'560 CHF	98.05%	2'510'080.00	0.08	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	1'300	0	0	1'300 CHF	98.32%	1'278'160.00	0.04	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	1'800	0	750	1'050 CHF	96.65%	1'014'825.00	0.03	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	1'050	0	500	550 CHF	93.10%	512'050.00	0.02	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	3'800	0	900	2'900 CHF	99.20%	2'876'800.00	0.09	a)
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	800	0	0	800 CHF	99.20%	793'600.00	0.03	a)
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	1'400	0	590	810 CHF	97.15%	786'915.00	0.03	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	3'740	0	1'240	2'500 CHF	98.71%	2'467'750.00	0.08	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	2'100	0	620	1'480 CHF	98.89%	1'463'572.00	0.05	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	1'300	0	0	1'300 CHF	99.13%	1'288'690.00	0.04	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	3'700	0	865	2'835 CHF	100.05%	2'836'417.50	0.09	a)
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	855	0	255	600 CHF	101.10%	606'600.00	0.02	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	1'060	0	0	1'060 CHF	106.70%	1'131'020.00	0.04	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	2'660	0	500	2'160 CHF	100.50%	2'170'800.00	0.07	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	3'505	0	695	2'810 CHF	100.60%	2'826'860.00	0.09	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	7'750	0	1'640	6'110 CHF	103.00%	6'293'300.00	0.21	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	4'300	0	1'205	3'095 CHF	106.83%	3'306'388.50	0.11	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'300	0	300	1'000 CHF	100.10%	1'001'000.00	0.03	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	4'500	0	850	3'650 CHF	100.22%	3'658'030.00	0.12	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	1'900	0	950	950 CHF	104.05%	988'475.00	0.03	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	2'150	0	0	2'150 CHF	100.60%	2'162'900.00	0.07	a)
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	1'600	0	300	1'300 CHF	99.60%	1'294'800.00	0.04	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	1'700	0	450	1'250 CHF	99.65%	1'245'625.00	0.04	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	925	0	0	925 CHF	99.50%	920'375.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	550	0	0	550 CHF	99.80%	548'900.00	0.02	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	2'400	0	700	1'700 CHF	100.90%	1'715'300.00	0.06	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	1'700	0	300	1'400 CHF	101.50%	1'421'000.00	0.05	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	8'550	0	2'590	5'960 CHF	102.74%	6'123'304.00	0.20	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	3'435	0	0	3'435 CHF	107.11%	3'679'228.50	0.12	a)
CH1182086848	1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37	1'200	0	350	850 CHF	99.25%	843'625.00	0.03	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	1'280	0	0	1'280 CHF	100.65%	1'288'320.00	0.04	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	1'800	0	300	1'500 CHF	101.30%	1'519'500.00	0.05	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	2'500	0	500	2'000 CHF	99.90%	1'998'000.00	0.07	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	1'305	0	300	1'005 CHF	100.50%	1'010'025.00	0.03	a)
CH1189217768	1.7000 % KTSPL 1.7 06/24/32	900	0	200	700 CHF	101.30%	709'100.00	0.02	a)
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	1'675	0	450	1'225 CHF	100.25%	1'228'062.50	0.04	a)
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	1'070	0	270	800 CHF	101.35%	810'800.00	0.03	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	5'600	0	1'830	3'770 CHF	102.84%	3'877'068.00	0.13	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	6'600	0	945	5'655 CHF	105.35%	5'957'542.50	0.19	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	2'400	1'800	350	3'850 CHF	114.45%	4'406'325.00	0.14	a)
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	1'000	500	400	1'100 CHF	127.75%	1'405'250.00	0.05	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	2'150	0	500	1'650 CHF	102.50%	1'691'250.00	0.06	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	2'700	0	0	2'700 CHF	102.69%	2'772'630.00	0.09	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	9'550	0	2'035	7'515 CHF	105.08%	7'896'762.00	0.26	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	3'800	0	600	3'200 CHF	108.09%	3'458'880.00	0.11	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	2'300	0	1'045	1'255 CHF	102.00%	1'280'100.00	0.04	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	1'350	0	400	950 CHF	100.06%	950'570.00	0.03	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	2'890	250	500	2'640 CHF	102.35%	2'702'040.00	0.09	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	4'200	3'700	725	7'175 CHF	104.16%	7'473'480.00	0.24	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'135	0	500	1'635 CHF	116.50%	1'904'775.00	0.06	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	1'800	0	500	1'300 CHF	101.90%	1'324'700.00	0.04	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	1'270	0	300	970 CHF	100.25%	972'425.00	0.03	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	1'500	0	300	1'200 CHF	102.40%	1'228'800.00	0.04	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	415	0	0	415 CHF	102.90%	427'035.00	0.01	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	1'900	0	1'200	700 CHF	103.40%	723'800.00	0.02	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	2'400	0	1'140	1'260 CHF	102.15%	1'287'090.00	0.04	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'110	0	0	1'110 CHF	101.95%	1'131'645.00	0.04	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	1'705	0	1'705	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	1'750	0	0	1'750 CHF	108.15%	1'892'625.00	0.06	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	1'350	0	0	1'350 CHF	100.70%	1'359'450.00	0.04	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	2'000	0	900	1'100 CHF	104.00%	1'144'000.00	0.04	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	4'500	0	0	4'500 CHF	108.80%	4'896'000.00	0.16	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	6'650	0	1'125	5'525 CHF	115.67%	6'390'767.50	0.21	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	4'050	0	730	3'320 CHF	131.98%	4'381'736.00	0.14	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	1'800	0	630	1'170 CHF	101.30%	1'185'210.00	0.04	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	6'000	0	1'305	4'695 CHF	101.15%	4'748'992.50	0.15	a)
CH1194355116	2.1250 % NESNVX 2 1/8 07/15/30	4'255	250	1'120	3'385 CHF	106.45%	3'603'332.50	0.12	a)
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	2'880	400	805	2'475 CHF	112.60%	2'786'850.00	0.09	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	860	0	300	560 CHF	111.05%	621'880.00	0.02	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	1'540	0	550	990 CHF	101.45%	1'004'355.00	0.03	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	855	250	450	655 CHF	115.80%	758'490.00	0.02	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	655	0	0	655 CHF	124.70%	816'785.00	0.03	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	940	0	0	940 CHF	102.65%	964'910.00	0.03	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	855	0	0	855 CHF	109.75%	938'362.50	0.03	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	2'870	0	0	2'870 CHF	110.23%	3'163'601.00	0.10	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	800	0	150	650 CHF	101.00%	656'500.00	0.02	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	3'800	0	0	3'800 CHF	102.79%	3'906'020.00	0.13	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	2'600	0	0	2'600 CHF	107.85%	2'804'100.00	0.09	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'400	0	400	1'000 CHF	99.95%	999'500.00	0.03	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	2'700	0	700	2'000 CHF	101.45%	2'029'000.00	0.07	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	1'860	0	595	1'265 CHF	104.75%	1'325'087.50	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	1'700	0	590	1'110 CHF	104.85%	1'163'835.00	0.04	a)
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	2'100	0	700	1'400 CHF	100.90%	1'412'600.00	0.05	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	1'890	0	500	1'390 CHF	103.35%	1'436'565.00	0.05	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	2'450	0	985	1'465 CHF	102.53%	1'502'064.50	0.05	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	5'700	0	1'920	3'780 CHF	109.29%	4'131'162.00	0.13	a)
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	960	0	300	660 CHF	102.10%	673'860.00	0.02	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	900	0	150	750 CHF	101.95%	764'625.00	0.02	a)
CH1206367471	2.5500 % GROUPE 2.55 09/30/32	860	0	200	660 CHF	108.40%	715'440.00	0.02	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	2'500	0	630	1'870 CHF	105.65%	1'975'655.00	0.06	a)
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	2'000	555	0	2'555 CHF	106.44%	2'719'542.00	0.09	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	2'300	0	0	2'300 CHF	111.05%	2'554'150.00	0.08	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'100	0	850	1'250 CHF	104.45%	1'305'625.00	0.04	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	1'100	0	200	900 CHF	101.27%	911'430.00	0.03	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	3'700	0	730	2'970 CHF	101.11%	3'002'967.00	0.10	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	4'900	350	815	4'435 CHF	106.74%	4'733'919.00	0.15	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	4'650	0	1'295	3'355 CHF	116.02%	3'892'471.00	0.13	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	1'360	0	600	760 CHF	121.70%	924'920.00	0.03	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	1'750	0	745	1'005 CHF	102.75%	1'032'637.50	0.03	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	2'200	0	600	1'600 CHF	104.45%	1'671'200.00	0.05	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	2'710	0	800	1'910 CHF	103.65%	1'979'715.00	0.06	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	2'000	0	950	1'050 CHF	101.00%	1'060'500.00	0.03	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	1'800	0	735	1'065 CHF	103.45%	1'101'742.50	0.04	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	900	0	435	465 CHF	101.50%	471'975.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	900	0	485	415 CHF	105.45%	437'617.50	0.01	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	800	0	0	800 CHF	103.75%	830'000.00	0.03	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	600	0	0	600 CHF	107.85%	647'100.00	0.02	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	3'500	0	0	3'500 CHF	100.95%	3'533'250.00	0.12	a)
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	3'350	0	400	2'950 CHF	107.00%	3'156'500.00	0.10	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	1'300	0	600	700 CHF	104.30%	730'100.00	0.02	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	1'900	0	300	1'600 CHF	110.35%	1'765'600.00	0.06	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	5'800	0	560	5'240 CHF	109.03%	5'713'172.00	0.19	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	103.10%	1'134'100.00	0.04	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797198	2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30	1'000	0	0	1'000 CHF	106.30%	1'063'000.00	0.03	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	2'660	0	700	1'960 CHF	103.30%	2'024'680.00	0.07	a)
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	1'750	0	0	1'750 CHF	120.65%	2'111'375.00	0.07	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	1'155	700	350	1'505 CHF	128.05%	1'927'152.50	0.06	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	1'800	0	545	1'255 CHF	104.05%	1'305'827.50	0.04	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	1'100	0	500	600 CHF	107.50%	645'000.00	0.02	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	4'400	440	530	4'310 CHF	108.56%	4'678'936.00	0.15	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	6'570	0	1'775	4'795 CHF	114.27%	5'479'246.50	0.18	a)
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	3'250	0	1'030	2'220 CHF	100.68%	2'235'096.00	0.07	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	780	0	0	780 CHF	144.65%	1'128'270.00	0.04	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	855	0	425	430 CHF	113.65%	488'695.00	0.02	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	1'620	0	600	1'020 CHF	103.00%	1'050'600.00	0.03	a)
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	2'950	350	1'220	2'080 CHF	106.15%	2'207'920.00	0.07	a)
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	2'100	300	700	1'700 CHF	115.15%	1'957'550.00	0.06	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	1'700	0	300	1'400 CHF	100.94%	1'413'160.00	0.05	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	2'750	0	690	2'060 CHF	104.95%	2'161'970.00	0.07	a)
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	1'500	0	540	960 CHF	104.90%	1'007'040.00	0.03	a)
CH1230442613	1.8750 % BCG 1 7/8 12/09/30	950	0	0	950 CHF	104.15%	989'425.00	0.03	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	1'900	0	400	1'500 CHF	102.08%	1'531'200.00	0.05	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	1'515	0	150	1'365 CHF	104.25%	1'423'012.50	0.05	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	2'500	0	850	1'650 CHF	100.85%	1'664'025.00	0.05	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	2'560	0	300	2'260 CHF	107.30%	2'424'980.00	0.08	a)
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	1'500	0	450	750 CHF	106.85%	801'375.00	0.03	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	2'100	0	0	2'100 CHF	105.30%	2'211'300.00	0.07	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	3'800	0	1'400	2'400 CHF	111.65%	2'679'600.00	0.09	a)
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	1'800	0	250	1'550 CHF	99.90%	1'548'450.00	0.05	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	1'610	0	400	1'210 CHF	101.49%	1'228'029.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	2'150	4'900	2'415	4'635 CHF	104.41%	4'839'403.50	0.16	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	5'600	0	1'065	4'535 CHF	107.19%	4'861'066.50	0.16	a)
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	1'000	0	250	750 CHF	102.75%	770'625.00	0.03	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	700	0	0	700 CHF	109.60%	767'200.00	0.03	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBSNW 2.05 07/24/28	2'050	0	310	1'740 CHF	103.75%	1'805'250.00	0.06	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	1'600	0	445	1'155 CHF	108.65%	1'254'907.50	0.04	a)
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	1'300	0	400	900 CHF	101.25%	911'250.00	0.03	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	900	0	0	900 CHF	103.25%	929'250.00	0.03	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	1'500	0	100	1'400 CHF	105.95%	1'483'300.00	0.05	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	900	0	250	650 CHF	104.65%	680'225.00	0.02	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	2'360	0	600	1'760 CHF	101.31%	1'783'056.00	0.06	a)
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	1'700	0	0	1'700 CHF	110.58%	1'879'860.00	0.06	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	850	0	150	700 CHF	123.75%	866'250.00	0.03	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'295	0	0	1'295 CHF	100.35%	1'299'532.50	0.04	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	2'985	0	800	2'185 CHF	113.92%	2'489'152.00	0.08	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	1'200	0	0	1'200 CHF	119.05%	1'428'600.00	0.05	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	1'300	0	450	850 CHF	137.60%	1'169'600.00	0.04	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	1'360	0	200	1'160 CHF	106.05%	1'230'180.00	0.04	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	3'800	0	600	3'200 CHF	103.90%	3'324'800.00	0.11	a)
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	4'850	0	1'605	3'245 CHF	105.41%	3'420'554.50	0.11	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	4'195	0	945	3'250 CHF	107.82%	3'504'150.00	0.11	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	2'070	0	0	2'070 CHF	110.51%	2'287'557.00	0.07	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	845	0	500	345 CHF	105.35%	363'457.50	0.01	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	1'100	0	0	1'100 CHF	103.65%	1'140'150.00	0.04	a)
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	920	0	0	920 CHF	104.90%	965'080.00	0.03	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	1'700	0	350	1'350 CHF	103.80%	1'401'300.00	0.05	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	3'250	0	0	3'250 CHF	103.64%	3'368'300.00	0.11	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	4'600	0	1'155	3'445 CHF	106.99%	3'685'805.50	0.12	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'400	0	600	800 CHF	104.05%	832'400.00	0.03	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	1'950	0	555	1'395 CHF	104.20%	1'453'590.00	0.05	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	1'650	0	0	1'650 CHF	109.25%	1'802'625.00	0.06	a)
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	2'100	0	1'165	935 CHF	101.12%	945'472.00	0.03	a)
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	1'100	0	250	850 CHF	103.95%	883'575.00	0.03	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	1'980	0	300	1'680 CHF	103.90%	1'745'520.00	0.06	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	2'135	0	0	2'135 CHF	108.35%	2'313'272.50	0.08	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLLI 2.35 03/01/27	1'525	0	600	925 CHF	102.30%	946'275.00	0.03	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLLI 2 3/4 03/01/30	1'820	0	350	1'470 CHF	107.35%	1'578'045.00	0.05	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	4'200	0	0	4'200 CHF	105.60%	4'435'200.00	0.14	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	4'435	0	1'195	3'240 CHF	103.05%	3'338'820.00	0.11	a)
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	900	0	250	650 CHF	105.50%	685'750.00	0.02	a)
CH1248666930	1.8750 % SCMNFX 1 7/8 08/23/30	1'590	0	725	865 CHF	104.45%	903'492.50	0.03	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	2'900	0	765	2'135 CHF	102.20%	2'181'970.00	0.07	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	4'100	0	855	3'245 CHF	106.96%	3'470'852.00	0.11	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	4'700	500	1'615	3'585 CHF	111.17%	3'985'444.50	0.13	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	2'025	0	2'025	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416087	2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32	2'050	0	550	1'500 CHF	108.60%	1'629'000.00	0.05	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	2'100	0	550	1'550 CHF	104.10%	1'613'550.00	0.05	a)
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	1'400	0	0	1'400 CHF	109.35%	1'530'900.00	0.05	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	1'035	0	400	635 CHF	105.25%	668'337.50	0.02	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	2'050	0	500	1'550 CHF	101.70%	1'576'350.00	0.05	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	2'200	0	455	1'745 CHF	104.45%	1'822'652.50	0.06	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	855	0	255	600 CHF	104.15%	624'900.00	0.02	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	2'500	0	1'045	1'455 CHF	102.90%	1'497'195.00	0.05	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	2'265	0	800	1'465 CHF	108.65%	1'591'722.50	0.05	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	4'500	0	1'040	3'460 CHF	108.01%	3'737'146.00	0.12	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	6'060	500	1'855	4'705 CHF	111.90%	5'264'895.00	0.17	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	2'560	0	1'050	1'510 CHF	105.25%	1'589'275.00	0.05	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	1'500	0	0	1'500 CHF	101.35%	1'520'250.00	0.05	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	1'200	0	0	1'200 CHF	106.00%	1'272'000.00	0.04	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	950	300	600	650 CHF	108.00%	702'000.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1264887386	2.6500 % EFIGC 2.65 06/06/28	900	0	250	650 CHF	103.40%	672'100.00	0.02	a)
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	1'600	0	350	1'250 CHF	100.75%	1'259'375.00	0.04	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	1'550	0	450	1'100 CHF	102.45%	1'126'950.00	0.04	a)
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	2'400	0	1'295	1'105 CHF	103.45%	1'143'122.50	0.04	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	1'700	0	1'100	600 CHF	101.80%	610'800.00	0.02	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	1'500	0	600	900 CHF	115.70%	1'041'300.00	0.03	a)
CH1265890801	1.6000 % KBBS 1.6 06/24/31 004	0	2'700	350	2'350 CHF	103.50%	2'432'250.00	0.08	a)
CH1265890827	1.6000 % KBBS 1.6 06/28/44 005	0	1'385	120	1'265 CHF	109.70%	1'387'705.00	0.05	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	830	0	200	630 CHF	153.25%	965'475.00	0.03	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	1'800	0	800	1'000 CHF	101.75%	1'017'500.00	0.03	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	1'265	0	350	915 CHF	110.55%	1'011'532.50	0.03	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	2'230	0	0	2'230 CHF	102.92%	2'295'116.00	0.07	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	2'000	0	700	1'300 CHF	105.85%	1'376'050.00	0.04	a)
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	1'780	0	380	1'400 CHF	101.50%	1'421'000.00	0.05	a)
CH1266847172	2.4000 % KENOVA 2.4 07/19/38	770	0	0	770 CHF	113.00%	870'100.00	0.03	a)
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	5'900	50	1'925	4'025 CHF	105.63%	4'251'607.50	0.14	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	5'100	0	1'980	3'120 CHF	110.18%	3'437'616.00	0.11	a)
CH1266847255	1.8000 % WKBSW 1.8 08/29/29	2'200	200	1'055	1'345 CHF	103.85%	1'396'782.50	0.05	a)
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	4'200	0	775	3'425 CHF	104.16%	3'567'480.00	0.12	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	5'900	180	1'835	4'245 CHF	107.07%	4'545'121.50	0.15	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	4'400	0	600	3'800 CHF	110.49%	4'198'620.00	0.14	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	1'385	0	200	1'185 CHF	106.95%	1'267'357.50	0.04	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	1'855	0	0	1'855 CHF	101.35%	1'880'042.50	0.06	a)
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	1'100	0	0	1'100 CHF	104.80%	1'152'800.00	0.04	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	2'450	0	1'195	1'255 CHF	102.75%	1'289'512.50	0.04	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	1'300	0	200	1'100 CHF	103.25%	1'135'750.00	0.04	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	780	800	900	680 CHF	103.00%	700'400.00	0.02	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	1'200	0	500	700 CHF	103.00%	721'000.00	0.02	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	2'850	0	755	2'095 CHF	104.00%	2'178'800.00	0.07	a)
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	4'000	350	1'145	3'205 CHF	107.50%	3'445'375.00	0.11	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	3'700	0	910	2'790 CHF	111.50%	3'110'850.00	0.10	a)
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	850	0	200	650 CHF	101.50%	659'750.00	0.02	a)
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	900	0	0	900 CHF	104.50%	940'500.00	0.03	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	2'300	1'300	900	2'700 CHF	109.30%	2'951'100.00	0.10	a)
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	1'060	0	1'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	4'600	0	575	4'025 CHF	114.01%	4'588'902.50	0.15	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	2'600	2'100	1'415	3'285 CHF	120.65%	3'963'352.50	0.13	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	1'400	0	300	1'100 CHF	105.30%	1'158'300.00	0.04	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	1'500	0	700	800 CHF	101.95%	815'600.00	0.03	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	4'200	1'800	880	5'120 CHF	106.21%	5'437'952.00	0.18	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	1'800	0	0	1'800 CHF	108.82%	1'958'760.00	0.06	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	2'160	0	300	1'860 CHF	106.15%	1'974'390.00	0.06	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	2'245	0	0	2'245 CHF	114.75%	2'576'137.50	0.08	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	1'400	0	0	1'400 CHF	106.60%	1'492'400.00	0.05	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	6'500	1'000	2'035	5'465 CHF	113.21%	6'186'926.50	0.20	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	3'100	0	0	3'100 CHF	106.42%	3'299'020.00	0.11	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	1'000	3'300	0	4'300 CHF	116.85%	5'024'550.00	0.16	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	1'300	0	540	760 CHF	105.30%	800'280.00	0.03	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	2'100	0	0	2'100 CHF	105.95%	2'224'950.00	0.07	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	1'500	0	0	1'500 CHF	102.00%	1'530'000.00	0.05	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	1'800	0	700	1'100 CHF	105.90%	1'164'900.00	0.04	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	2'400	0	1'000	1'400 CHF	102.95%	1'441'300.00	0.05	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	1'600	0	400	1'200 CHF	103.25%	1'239'000.00	0.04	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	1'935	0	600	1'335 CHF	105.05%	1'402'417.50	0.05	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	1'900	0	830	1'070 CHF	106.90%	1'143'830.00	0.04	a)
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	1'500	0	300	1'200 CHF	109.40%	1'312'800.00	0.04	a)
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	900	0	250	650 CHF	137.55%	894'075.00	0.03	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	1'300	0	300	1'000 CHF	103.45%	1'034'500.00	0.03	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	2'010	0	630	1'380 CHF	104.25%	1'438'650.00	0.05	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	3'150	0	1'380	1'770 CHF	113.50%	2'008'950.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	3'450	0	1'000	2'450 CHF	99.40%	2'435'300.00	0.08	a)
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	3'200	0	600	2'600 CHF	106.57%	2'770'820.00	0.09	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	2'300	0	1'050	1'250 CHF	110.41%	1'380'125.00	0.05	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	2'100	0	600	1'500 CHF	102.30%	1'534'500.00	0.05	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	1'600	300	800	1'100 CHF	106.60%	1'172'600.00	0.04	a)
CH1290222509	1.7000 % TESSIN 1.7 10/31/33	3'100	0	1'075	2'025 CHF	107.55%	2'177'887.50	0.07	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	1'800	0	950	850 CHF	113.35%	963'475.00	0.03	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	1'500	300	565	1'235 CHF	102.65%	1'267'727.50	0.04	a)
CH1290222541	2.4000 % AMALEA 2.4 11/22/30	1'500	200	550	1'150 CHF	106.05%	1'219'575.00	0.04	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	2'700	0	1'200	1'500 CHF	102.50%	1'537'500.00	0.05	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	2'200	0	300	1'900 CHF	106.90%	2'031'100.00	0.07	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	1'830	0	565	1'265 CHF	104.35%	1'320'027.50	0.04	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	1'620	0	600	1'020 CHF	108.00%	1'101'600.00	0.04	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	1'600	0	600	1'000 CHF	104.05%	1'040'500.00	0.03	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	3'590	0	895	2'695 CHF	101.75%	2'742'162.50	0.09	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	3'420	0	1'070	2'350 CHF	107.40%	2'523'900.00	0.08	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRI 1.9 09/08/26	1'300	0	500	800 CHF	101.70%	813'600.00	0.03	a)
CH1290991327	1.1250 % KBBL 1 1/8 08/29/34	0	2'000	0	2'000 CHF	100.05%	2'001'000.00	0.07	a)
CH1290991335	1.0200 % KBBL 1.02 09/19/44	0	1'200	0	1'200 CHF	99.48%	1'193'796.00	0.04	a)
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	0	675	0	675 CHF	101.10%	682'425.00	0.02	a)
CH1291601941	1.5200 % ACANXB 1.52 03/25/33	0	1'235	500	735 CHF	102.40%	752'640.00	0.02	a)
CH1291601958	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44 MAY	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291601966	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28 MAY	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291827355	1.8300 % KBSCHEW 1.83 09/21/28	1'100	0	310	790 CHF	103.05%	814'095.00	0.03	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	2'900	0	700	2'200 CHF	101.80%	2'239'600.00	0.07	a)
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	1'500	0	800	700 CHF	103.50%	724'500.00	0.02	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	2'515	0	650	1'865 CHF	107.40%	2'003'010.00	0.07	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	2'900	0	825	2'075 CHF	102.45%	2'125'837.50	0.07	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	1'500	0	800	700 CHF	104.10%	728'700.00	0.02	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	1'515	0	700	815 CHF	107.60%	876'940.00	0.03	a)
CH1293714361	2.3750 % INSBER 2 3/8 09/29/31	1'000	0	330	670 CHF	105.45%	706'515.00	0.02	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	1'600	0	650	950 CHF	110.45%	1'049'275.00	0.03	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	3'000	0	555	2'445 CHF	101.50%	2'481'675.00	0.08	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	4'455	0	900	3'555 CHF	107.45%	3'819'847.50	0.12	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	1'900	0	0	1'900 CHF	112.65%	2'140'350.00	0.07	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	900	0	435	465 CHF	101.50%	471'975.00	0.02	a)
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	1'050	0	150	900 CHF	106.00%	954'000.00	0.03	a)
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	1'550	0	400	1'150 CHF	102.05%	1'173'575.00	0.04	a)
CH1300277840	1.8750 % NESNVX 1 7/8 11/20/31	2'000	0	500	1'500 CHF	105.55%	1'583'250.00	0.05	a)
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	2'150	0	400	1'750 CHF	109.00%	1'907'500.00	0.06	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	1'150	0	600	550 CHF	102.10%	561'550.00	0.02	a)
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	1'800	0	845	955 CHF	107.40%	1'025'670.00	0.03	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	1'500	0	250	1'250 CHF	103.20%	1'290'000.00	0.04	a)
CH1300277899	2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31	2'000	190	800	1'390 CHF	106.35%	1'478'265.00	0.05	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	3'125	150	950	2'325 CHF	107.50%	2'499'375.00	0.08	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	1'500	0	600	900 CHF	102.55%	922'950.00	0.03	a)
CH1305916772	1.7500 % ROSW 1 3/4 09/15/33	2'000	0	800	1'200 CHF	105.50%	1'266'000.00	0.04	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	2'300	0	650	1'650 CHF	108.85%	1'796'025.00	0.06	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	3'600	0	1'220	2'380 CHF	109.05%	2'595'390.00	0.08	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	1'800	0	800	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.03	a)
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	1'400	0	400	1'000 CHF	105.75%	1'057'500.00	0.03	a)
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	1'900	0	1'050	850 CHF	105.50%	896'750.00	0.03	a)
CH1306117073	1.4500 % ZURICH 1.45 12/01/34	1'200	0	730	470 CHF	106.45%	500'315.00	0.02	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	1'400	1'900	0	3'300 CHF	101.51%	3'349'830.00	0.11	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	1'800	2'900	2'170	2'530 CHF	102.87%	2'602'611.00	0.08	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	2'600	0	1'150	1'450 CHF	105.02%	1'522'790.00	0.05	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	1'200	0	600	600 CHF	101.70%	610'200.00	0.02	a)
CH1306117149	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/34	675	0	0	675 CHF	104.20%	703'350.00	0.02	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	600	0	0	600 CHF	108.90%	653'400.00	0.02	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	1'000	0	350	650 CHF	115.40%	750'100.00	0.02	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLLI 2 1/4 12/05/25	900	0	0	900 CHF	101.31%	911'790.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1307121272	2.3750 % KWLIL 2 3/8 12/05/29	420	400	0	820 CHF	105.30%	863'460.00	0.03	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	0	2'900	0	2'900 CHF	105.39%	3'056'310.00	0.10	a)
CH1310346247	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 12/21/38 749	2'400	0	540	1'860 CHF	107.34%	1'996'524.00	0.07	a)
CH1310346262	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 05/28/30 751	0	3'000	1'660	1'340 CHF	101.65%	1'362'110.00	0.04	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	3'700	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346296	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 MAR	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346304	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 03/25/33	0	1'800	100	1'700 CHF	103.55%	1'760'350.00	0.06	a)
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	2'130	870	1'260 CHF	108.75%	1'370'250.00	0.04	a)
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	1'600	0	500	1'100 CHF	103.90%	1'142'900.00	0.04	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	2'200	0	200	2'000 CHF	101.50%	2'030'000.00	0.07	a)
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	3'700	0	800	2'900 CHF	103.80%	3'010'200.00	0.10	a)
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	900	0	0	900 CHF	101.75%	915'750.00	0.03	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	1'200	0	0	1'200 CHF	103.70%	1'244'400.00	0.04	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	2'400	0	750	1'650 CHF	103.10%	1'701'150.00	0.06	a)
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	1'700	1'200	0	2'900 CHF	103.34%	2'996'860.00	0.10	a)
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	4'500	0	1'085	3'415 CHF	104.49%	3'568'333.50	0.12	a)
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	1'100	1'000	600	1'500 CHF	106.86%	1'602'900.00	0.05	a)
CH1319968447	1.2000 % ZURICH 1.2 03/07/30	3'000	0	955	2'045 CHF	102.55%	2'097'147.50	0.07	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	2'200	0	700	1'500 CHF	104.45%	1'566'750.00	0.05	a)
CH1319968462	1.4150 % LUGANO 1.415 03/07/34	1'600	0	1'135	465 CHF	104.45%	485'692.50	0.02	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	2'600	0	800	1'800 CHF	101.80%	1'832'400.00	0.06	a)
CH1319968512	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 MAR	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	4'100	200	1'935	2'365 CHF	103.42%	2'445'883.00	0.08	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	2'960	0	1'000	1'960 CHF	104.82%	2'054'472.00	0.07	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	800	0	800 CHF	103.15%	825'200.00	0.03	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	2'800	1'400	1'400 CHF	105.05%	1'470'700.00	0.05	a)
CH1319968579	2.1000 % ALLNSW 2.1 04/04/31	0	1'700	660	1'040 CHF	103.45%	1'075'880.00	0.04	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	4'630	1'485	3'145 CHF	104.20%	3'277'090.00	0.11	a)
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	1'150	350	800 CHF	102.70%	821'600.00	0.03	a)
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968611	1.4000 % PFZENT 1.4 11/06/34 590	0	7'700	4'060	3'640 CHF	103.31%	3'760'484.00	0.12	a)
CH1319968629	1.4000 % PFZENT 1.4 03/15/38 591	0	3'000	0	3'000 CHF	104.35%	3'130'500.00	0.10	a)
CH1319968645	1.5000 % KBSH 1 1/2 04/25/36	0	2'200	950	1'250 CHF	104.20%	1'302'500.00	0.04	a)
CH1319968678	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 MAY	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968686	1.4500 % PFZENT 1.45 12/07/33 592	0	3'200	450	2'750 CHF	103.63%	2'849'825.00	0.09	a)
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	0	2'900	1'475	1'425 CHF	105.57%	1'504'372.50	0.05	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	1'800	0	250	1'550 CHF	101.05%	1'566'275.00	0.05	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	2'300	0	705	1'595 CHF	104.70%	1'669'965.00	0.05	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	1'890	0	0	1'890 CHF	103.00%	1'946'700.00	0.06	a)
CH1323274055	2.0000 % LGT 2 02/15/34 EMTN	2'100	0	500	1'600 CHF	105.35%	1'685'600.00	0.05	a)
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	3'100	3'400	2'390	4'110 CHF	107.48%	4'417'428.00	0.14	a)
CH1325037021	1.7000 % DAESW 1.7 10/30/29	0	1'500	750	750 CHF	101.75%	763'125.00	0.02	a)
CH1325037039	1.5000 % BQTESS 1 1/2 05/03/34	0	2'400	1'800	600 CHF	102.55%	615'300.00	0.02	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	1'200	400	800 CHF	101.35%	810'800.00	0.03	a)
CH1325037054	1.3000 % NEUNBG 1.3 06/12/48	0	1'500	450	1'050 CHF	110.05%	1'155'525.00	0.04	a)
CH1325037062	0.7000 % KTBS 0.7 09/06/30	0	1'700	0	1'700 CHF	100.07%	1'701'156.00	0.06	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	750	500	300	950 CHF	104.40%	991'800.00	0.03	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	525	400	225	700 CHF	124.55%	871'850.00	0.03	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	1'300	0	500	800 CHF	101.00%	808'000.00	0.03	a)
CH1331113501	2.3750 % CLNVX 2 3/8 03/30/27	0	1'825	400	1'425 CHF	102.20%	1'456'350.00	0.05	a)
CH1331113519	2.7500 % CLNVX 2 3/4 03/28/31	0	1'410	540	870 CHF	105.90%	921'330.00	0.03	a)
CH1331113634	1.6500 % GALESW 1.65 04/30/31	0	1'040	440	600 CHF	101.45%	608'700.00	0.02	a)
CH1331440235	1.4500 % KBSCHW 1.45 03/14/31	900	0	300	600 CHF	102.25%	613'500.00	0.02	a)
CH1337248962	1.6500 % PSPNSW 1.65 10/11/32	0	1'500	650	850 CHF	101.70%	864'450.00	0.03	a)
CH1337248970	1.2000 % BERN 1.2 04/22/39	0	2'200	915	1'285 CHF	104.85%	1'347'322.50	0.04	a)
CH1337248988	2.1175 % RAIFFS 2.1175 05/14/32	0	700	0	700 CHF	103.15%	722'050.00	0.02	a)
CH1337249010	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 MAY	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249028	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 MAY	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249044	1.1500 % KTBL 1.15 06/24/33	0	1'300	800	500 CHF	103.50%	517'500.00	0.02	a)
CH1340267090	1.3500 % KBAARG 1.35 04/30/31	0	1'735	485	1'250 CHF	101.75%	1'271'875.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1341034978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/19/39 753	0	3'000	755	2'245 CHF	106.00%	2'379'700.00	0.08	a)
CH1341034986	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/24/54 754	0	2'700	720	1'980 CHF	111.20%	2'201'760.00	0.07	a)
CH1341034994	1.4100 % SLHNVX 1.41 04/26/27	0	360	0	360 CHF	100.75%	362'700.00	0.01	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNVX 1.5025 04/26/30	0	1'870	500	1'370 CHF	101.45%	1'389'865.00	0.05	a)
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	2'300	675	1'625 CHF	102.45%	1'664'812.50	0.05	a)
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	0	4'600	1'565	3'035 CHF	102.80%	3'119'980.00	0.10	a)
CH1344316745	1.3750 % NESNVX 1 3/8 11/30/28	0	2'700	1'280	1'420 CHF	101.50%	1'441'300.00	0.05	a)
CH1344316752	1.5000 % NESNVX 1 1/2 05/30/31	0	2'400	800	1'600 CHF	102.90%	1'646'400.00	0.05	a)
CH1344316760	1.6250 % NESNVX 1 5/8 05/30/34	0	4'600	1'175	3'425 CHF	104.25%	3'570'562.50	0.12	a)
CH1344316778	1.7500 % NESNVX 1 3/4 05/30/40	0	3'700	1'340	2'360 CHF	107.00%	2'525'200.00	0.08	a)
CH1346742856	2.1000 % KSAARA 2.1 05/15/34	0	1'400	600	800 CHF	104.60%	836'800.00	0.03	a)
CH1346742864	1.5000 % BQNCHT 1 1/2 05/23/34	0	1'700	950	750 CHF	103.10%	773'250.00	0.03	a)
CH1346742898	1.6500 % VISECA 1.65 06/06/28	0	1'500	200	1'300 CHF	101.30%	1'316'900.00	0.04	a)
CH1346742914	2.4000 % SGKNSW 2.4 05/30/34	0	1'585	0	1'585 CHF	105.00%	1'664'250.00	0.05	a)
CH1346742930	1.9000 % PGHNSW 1.9 06/07/30	0	1'800	200	1'600 CHF	103.00%	1'648'000.00	0.05	a)
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	0	3'100	700	2'400 CHF	105.10%	2'522'400.00	0.08	a)
CH1346742963	2.1000 % LUZKAN 2.1 06/21/34	0	1'890	700	1'190 CHF	104.90%	1'248'310.00	0.04	a)
CH1346742971	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 JUN	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742989	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 594	0	6'900	300	6'600 CHF	103.74%	6'846'840.00	0.22	a)
CH1346742997	1.4500 % PFZENT 1.45 10/10/39 595	0	1'900	0	1'900 CHF	105.46%	2'003'740.00	0.07	a)
CH1346743003	1.3750 % EGW 1 3/8 06/21/44 71	0	1'500	0	1'500 CHF	109.80%	1'647'000.00	0.05	a)
CH1346743011	1.8500 % WASSER 1.85 07/01/38	0	1'280	0	1'280 CHF	107.45%	1'375'360.00	0.04	a)
CH1346743029	2.0500 % MOBNSW 2.05 07/01/30	0	1'700	0	1'700 CHF	102.90%	1'749'300.00	0.06	a)
CH1346743037	1.2530 % RHBSZS 1.253 06/18/40	0	1'600	850	750 CHF	106.25%	796'875.00	0.03	a)
CH1346743052	1.3000 % ZURICH 1.3 06/24/37	0	3'700	1'305	2'395 CHF	106.05%	2'539'897.50	0.08	a)
CH1346743060	1.7500 % COOPSW 1 3/4 07/17/28	0	1'300	0	1'300 CHF	102.00%	1'326'000.00	0.04	a)
CH1346743078	1.8500 % COOPSW 1.85 07/16/32	0	3'400	0	3'400 CHF	103.95%	3'534'300.00	0.12	a)
CH1346743094	1.6000 % BQTESS 1.6 07/10/36	0	2'200	0	2'200 CHF	104.20%	2'292'400.00	0.07	a)
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	0	900	0	900 CHF	101.10%	909'900.00	0.03	a)
CH1348614046	1.8000 % BARY 1.8 05/15/26	0	1'600	0	1'600 CHF	100.70%	1'611'200.00	0.05	a)
CH1348614053	2.0500 % BARY 2.05 05/17/30	0	3'000	800	2'200 CHF	102.75%	2'260'500.00	0.07	a)
CH1348614061	2.4000 % BARY 2.4 05/17/34	0	2'400	450	1'950 CHF	104.95%	2'046'525.00	0.07	a)
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	1'800	545	1'255 CHF	102.10%	1'281'355.00	0.04	a)
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	0	1'540	180	1'360 CHF	104.40%	1'419'840.00	0.05	a)
CH1348614145	1.7500 % BALHOL 1 3/4 06/07/34	0	1'700	0	1'700 CHF	103.10%	1'752'700.00	0.06	a)
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	3'400	1'200	2'200 CHF	102.45%	2'253'900.00	0.07	a)
CH1348614178	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 06/04/35	0	1'500	590	910 CHF	104.00%	946'400.00	0.03	a)
CH1348614186	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40 JUN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614194	1.3000 % ZURCTY 1.3 06/04/49	0	1'500	310	1'190 CHF	110.30%	1'312'570.00	0.04	a)
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	1'700	750	950 CHF	102.05%	969'475.00	0.03	a)
CH1348968657	1.6000 % GRKPSW 1.6 06/26/34	0	1'600	655	945 CHF	104.50%	987'525.00	0.03	a)
CH1349191804	1.6000 % BCG 1.6 06/10/30	0	1'500	0	1'500 CHF	102.35%	1'535'250.00	0.05	a)
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	1'000	0	1'000 CHF	101.00%	1'010'000.00	0.03	a)
CH1349643085	1.7000 % BCVAUD 1.7 06/04/38	0	1'500	0	1'500 CHF	105.95%	1'589'250.00	0.05	a)
CH1350727785	1.6500 % SCMNVX 1.65 08/23/30	0	3'000	600	2'400 CHF	103.00%	2'472'000.00	0.08	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMNVX 1.8 08/23/34	0	4'000	725	3'275 CHF	105.35%	3'450'212.50	0.11	a)
CH1350727801	2.0000 % SCMNVX 2 11/23/39	0	3'850	1'150	2'700 CHF	107.95%	2'914'650.00	0.10	a)
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	0	2'200	0	2'200 CHF	101.25%	2'227'500.00	0.07	a)
CH1353015014	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 JUL	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015022	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 07/24/37 757	0	2'200	0	2'200 CHF	103.40%	2'274'800.00	0.07	a)
CH1353015030	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/24/47 758	0	1'700	0	1'700 CHF	105.12%	1'787'040.00	0.06	a)
CH1353015055	1.0000 % KTBL 1 03/05/40 SEP	0	1'050	0	1'050 CHF	102.38%	1'074'969.00	0.04	a)
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	0	2'200	440	1'760 CHF	102.05%	1'796'080.00	0.06	a)
CH1353257764	2.5000 % FERHOL 2 1/2 06/28/33	0	1'400	560	840 CHF	104.55%	878'220.00	0.03	a)
CH1353257806	1.6000 % NOVNVX 1.6 06/18/27	0	6'100	1'800	4'300 CHF	101.95%	4'383'850.00	0.14	a)
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	0	4'300	975	3'325 CHF	103.85%	3'453'012.50	0.11	a)
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	0	6'300	1'300	5'000 CHF	105.90%	5'295'000.00	0.17	a)
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	0	2'900	1'000	1'900 CHF	108.85%	2'068'150.00	0.07	a)
CH1353257848	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/49	0	2'000	800	1'200 CHF	114.15%	1'369'800.00	0.04	a)
CH1353257863	1.9500 % HELNSW 1.95 06/26/34	0	2'400	0	2'400 CHF	105.35%	2'528'400.00	0.08	a)
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	3'900	0	3'900 CHF	101.73%	3'967'470.00	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1353257889	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 JUN	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257897	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 JUN	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257913	1.9950 % EFGBNK 1.995 06/28/27	0	1'600	0	1'600 CHF	101.40%	1'622'400.00	0.05	a)
CH1353257921	2.1575 % EFGBNK 2.1575 06/28/30	0	1'500	600	900 CHF	102.90%	926'100.00	0.03	a)
CH1353257939	1.6250 % KWOBER 1 5/8 07/16/32	0	1'120	0	1'120 CHF	103.10%	1'154'720.00	0.04	a)
CH1356524871	1.4295 % LAUSAN 1.4295 06/28/46	0	1'300	600	700 CHF	109.50%	766'500.00	0.02	a)
CH1357852651	1.6925 % SRAIL 1.6925 07/12/29	0	1'000	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.03	a)
CH1357852669	1.9950 % SRAIL 1.995 07/12/32	0	1'000	0	1'000 CHF	102.15%	1'021'500.00	0.03	a)
CH1357852693	1.6500 % SPSNSW 1.65 07/16/29	0	1'700	0	1'700 CHF	101.10%	1'718'700.00	0.06	a)
CH1357852784	1.4500 % IRENSW 1.45 10/16/26	0	700	0	700 CHF	100.35%	702'450.00	0.02	a)
CH1360255025	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41 JUN	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401701	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 JUL	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401719	1.2500 % PFZENT 1 1/4 04/19/33 596	0	1'600	0	1'600 CHF	101.84%	1'629'440.00	0.05	a)
CH1361401727	1.3000 % PFZENT 1.3 11/14/39 597	0	1'400	0	1'400 CHF	103.33%	1'446'620.00	0.05	a)
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	0	810	0	810 CHF	101.25%	820'125.00	0.03	a)
CH1361401743	1.4000 % IWBBAS 1.4 07/13/34	0	960	0	960 CHF	102.20%	981'120.00	0.03	a)
CH1361401784	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 AUG	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401792	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 AUG	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401800	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 AUG	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401842	1.1250 % ZKB 1 1/8 08/16/34 158	0	2'100	0	2'100 CHF	100.20%	2'104'200.00	0.07	a)
CH1361401867	1.2000 % WKBNWS 1.2 09/03/36	0	1'800	0	1'800 CHF	99.30%	1'787'400.00	0.06	a)
CH1361401875	1.2000 % SCMNVS 1.2 09/03/35	0	1'000	0	1'000 CHF	99.65%	996'500.00	0.03	a)
CH1361401883	1.1250 % GEBNVX 1 1/8 09/10/31	0	1'600	0	1'600 CHF	100.20%	1'603'168.00	0.05	a)
CH1361401891	1.5606 % BCHNSW 1.5606 09/29/28	0	1'400	0	1'400 CHF	99.93%	1'399'076.00	0.05	a)
CH1366517105	1.1300 % THURBK 1.13 08/29/44	0	2'000	0	2'000 CHF	100.60%	2'012'000.00	0.07	a)
CH1371736740	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 AUG	0	2'700	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1371736757	1.0000 % PSHYPO 1 06/07/33 759	0	1'400	0	1'400 CHF	99.81%	1'397'340.00	0.05	a)
CH1371736765	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 12/23/39 760	0	2'200	0	2'200 CHF	100.91%	2'220'020.00	0.07	a)
CH1371736773	1.0000 % PSHYPO 1 04/28/49 761	0	2'200	0	2'200 CHF	100.34%	2'207'480.00	0.07	a)
CH1371736807	0.9850 % ROSW 0.985 09/06/29	0	1'300	0	1'300 CHF	99.92%	1'298'895.00	0.04	a)
CH1371736815	1.0975 % ROSW 1.0975 09/06/34	0	2'700	0	2'700 CHF	99.65%	2'690'577.00	0.09	a)
CH1371736823	1.1700 % ROSW 1.17 09/06/39	0	1'900	0	1'900 CHF	99.24%	1'885'503.00	0.06	a)
CH1373904262	0.8000 % ZURCTY 0.8 12/09/26	0	700	0	700 CHF	100.15%	701'071.00	0.02	a)
CH1373904270	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/08/34	0	1'200	0	1'200 CHF	100.28%	1'203'312.00	0.04	a)
CH1373904288	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/09/50	0	1'500	0	1'500 CHF	100.53%	1'507'935.00	0.05	a)
CH1373904353	1.2000 % PSPNSW 1.2 09/20/29	0	1'500	0	1'500 CHF	99.78%	1'496'730.00	0.05	a)
CH1373904361	1.4000 % PSPNSW 1.4 09/20/34	0	1'200	0	1'200 CHF	99.25%	1'191'012.00	0.04	a)
CH1373904387	1.3000 % KENOVA 1.3 09/26/34	0	1'000	0	1'000 CHF	99.91%	999'100.00	0.03	a)
CH1373904395	0.9500 % EGW 0.95 09/23/44 72	0	1'000	0	1'000 CHF	101.78%	1'017'770.00	0.03	a)
CH1373904403	1.6000 % GALDSW 1.6 09/27/28	0	1'900	0	1'900 CHF	100.38%	1'907'296.00	0.06	a)
CH1373904411	1.9000 % GALDSW 1.9 09/27/32	0	2'100	0	2'100 CHF	100.35%	2'107'371.00	0.07	a)
CH1373904429	1.5000 % UNIZUE 1 1/2 09/27/32	0	1'400	0	1'400 CHF	100.30%	1'404'200.00	0.05	a)
CH1373904437	1.6500 % UNIZUE 1.65 09/26/36	0	1'400	0	1'400 CHF	100.32%	1'404'522.00	0.05	a)
CH1375588105	1.1000 % KBFRI 1.1 09/09/31	0	1'000	0	1'000 CHF	99.95%	999'510.00	0.03	a)
CH1377443804	1.6500 % ZUGNSW 1.65 09/16/31	0	1'000	0	1'000 CHF	99.75%	997'470.00	0.03	a)
CHF							3'040'563'482.90	99.17	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'739'208.63	0.09
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'040'563'482.90	99.17
Sonstige Vermögenswerte	22'835'957.77	0.74
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'066'138'649.30	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-11'527.00	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'066'127'122.30	

Bewertungskategorien		Kurswert CHF	in % (7)
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	3'040'563'482.90	99.17
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

Ausgeliehene Effekten		953'535'975.10	31.10
-----------------------	--	----------------	-------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte					953'535'975.10	31.10
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	39'176	CHF	112.44%	44'049'494.40	1.44
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	19'817	CHF	181.70%	36'007'489.00	1.17
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	32'834	CHF	125.61%	41'242'787.40	1.35
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	31'912	CHF	122.98%	39'245'377.60	1.28
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	5'100	CHF	103.55%	5'281'050.00	0.17
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	21'503	CHF	107.64%	23'145'829.20	0.75
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	1'000	CHF	109.11%	1'091'100.00	0.04
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	500	CHF	105.35%	526'750.00	0.02
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	500	CHF	109.61%	548'050.00	0.02
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	800	CHF	112.00%	896'000.00	0.03
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	1'000	CHF	105.15%	1'051'500.00	0.03
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	660	CHF	123.50%	815'100.00	0.03
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	100	CHF	119.45%	119'450.00	0.00
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	500	CHF	124.65%	623'250.00	0.02
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	500	CHF	102.35%	511'750.00	0.02
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	23'583	CHF	111.80%	26'365'794.00	0.86
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	29'454	CHF	117.39%	34'576'050.60	1.13
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	28'356	CHF	109.87%	31'154'737.20	1.02
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	1'000	CHF	122.60%	1'226'000.00	0.04
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	500	CHF	109.50%	547'500.00	0.02
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	500	CHF	101.53%	507'650.00	0.02
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	1'385	CHF	101.85%	1'410'622.50	0.05
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	500	CHF	104.80%	524'000.00	0.02
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'400	CHF	101.10%	1'415'400.00	0.05
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	500	CHF	105.90%	529'500.00	0.02
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	500	CHF	101.45%	507'250.00	0.02
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	250	CHF	112.00%	280'000.00	0.01
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	755	CHF	108.30%	817'665.00	0.03
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	26'512	CHF	101.20%	26'830'144.00	0.88
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	23'790	CHF	163.00%	38'777'700.00	1.26
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	26'060	CHF	100.01%	26'062'606.00	0.85
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	18'000	CHF	103.24%	18'583'200.00	0.61
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	35'198	CHF	97.67%	34'377'886.60	1.12
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	500	CHF	100.35%	501'750.00	0.02
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	500	CHF	104.85%	524'250.00	0.02
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'100	CHF	100.65%	2'113'650.00	0.07
CH0254147504	1.5000 % SCMNVDX 1 1/2 09/28/29	500	CHF	102.35%	511'750.00	0.02
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	500	CHF	100.80%	504'000.00	0.02
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	800	CHF	100.17%	801'360.00	0.03
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	1'000	CHF	106.65%	1'066'500.00	0.03
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	500	CHF	100.27%	501'350.00	0.02
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	4'500	CHF	97.00%	4'365'000.00	0.14
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	1'605	CHF	97.30%	1'561'665.00	0.05
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	500	CHF	98.20%	491'000.00	0.02
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	500	CHF	97.55%	487'750.00	0.02
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	1'000	CHF	99.50%	995'000.00	0.03
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	2'200	CHF	103.30%	2'272'600.00	0.07
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	500	CHF	98.65%	493'250.00	0.02
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	3'500	CHF	98.45%	3'445'750.00	0.11
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	500	CHF	98.55%	492'750.00	0.02
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	500	CHF	96.71%	483'550.00	0.02
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	500	CHF	99.84%	499'200.00	0.02
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	500	CHF	99.95%	499'750.00	0.02

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	2'000 CHF	100.03%	2'000'600.00	0.07
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	5'500 CHF	99.16%	5'453'800.00	0.18
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	750 CHF	98.15%	736'125.00	0.02
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	2'800 CHF	97.94%	2'742'320.00	0.09
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	500 CHF	97.45%	487'250.00	0.02
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	1'000 CHF	94.98%	949'800.00	0.03
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	200 CHF	100.19%	200'380.00	0.01
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	1'000 CHF	94.93%	949'300.00	0.03
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	1'200 CHF	99.40%	1'192'800.00	0.04
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	1'900 CHF	95.35%	1'811'650.00	0.06
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	500 CHF	95.85%	479'250.00	0.02
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	2'850 CHF	94.45%	2'691'825.00	0.09
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	800 CHF	99.25%	794'000.00	0.03
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	1'000 CHF	90.45%	904'500.00	0.03
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	1'295 CHF	98.45%	1'274'927.50	0.04
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	500 CHF	96.50%	482'500.00	0.02
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	1'100 CHF	88.25%	970'750.00	0.03
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	3'275 CHF	87.85%	2'877'087.50	0.09
CH0336352775	0.1250 % SCMNXX 0 1/8 09/15/32	1'800 CHF	93.30%	1'679'400.00	0.05
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	5'430 CHF	94.09%	5'109'087.00	0.17
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	1'505 CHF	99.14%	1'492'057.00	0.05
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	2'200 CHF	88.91%	1'956'020.00	0.06
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	1'000 CHF	91.25%	912'500.00	0.03
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	500 CHF	97.70%	488'500.00	0.02
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	500 CHF	97.80%	489'000.00	0.02
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	500 CHF	97.55%	487'750.00	0.02
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	18'630 CHF	102.10%	19'021'230.00	0.62
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	27'813 CHF	100.64%	27'991'003.20	0.91
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	22'917 CHF	100.12%	22'944'500.40	0.75
CH0350030422	0.7000 % KWOBBER 0.7 01/30/26	500 CHF	99.22%	496'100.00	0.02
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	3'000 CHF	98.36%	2'950'800.00	0.10
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	815 CHF	99.01%	806'931.50	0.03
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	1'500 CHF	97.67%	1'465'050.00	0.05
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	1'000 CHF	99.10%	991'000.00	0.03
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	15 CHF	98.80%	14'820.00	0.00
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	2'500 CHF	98.77%	2'469'250.00	0.08
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	600 CHF	97.75%	586'500.00	0.02
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	500 CHF	99.20%	496'000.00	0.02
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	845 CHF	98.05%	828'522.50	0.03
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	800 CHF	98.75%	790'000.00	0.03
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	1'000 CHF	95.66%	956'600.00	0.03
CH0362748359	0.3750 % SCMNXX 0 3/8 05/31/27	2'000 CHF	98.30%	1'966'000.00	0.06
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	500 CHF	97.15%	485'750.00	0.02
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	500 CHF	94.00%	470'000.00	0.02
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	750 CHF	96.95%	727'125.00	0.02
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	1'000 CHF	97.82%	978'200.00	0.03
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000 CHF	97.75%	977'500.00	0.03
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	1'400 CHF	99.15%	1'388'100.00	0.05
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	800 CHF	97.80%	782'400.00	0.03
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	650 CHF	98.35%	639'275.00	0.02
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	1'000 CHF	98.35%	983'500.00	0.03
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	2'150 CHF	99.49%	2'139'035.00	0.07
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	500 CHF	98.84%	494'200.00	0.02
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	500 CHF	98.00%	490'000.00	0.02
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	100 CHF	98.50%	98'500.00	0.00
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	1'000 CHF	98.91%	989'100.00	0.03
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	500 CHF	96.75%	483'750.00	0.02
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	500 CHF	97.91%	489'550.00	0.02
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'020 CHF	97.70%	996'540.00	0.03
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	900 CHF	99.25%	893'250.00	0.03
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	500 CHF	98.55%	492'750.00	0.02

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	1'400 CHF	99.20%	1'388'800.00	0.05	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	1'400 CHF	97.31%	1'362'340.00	0.04	
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	500 CHF	97.55%	487'750.00	0.02	
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	300 CHF	101.55%	304'650.00	0.01	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	450 CHF	98.85%	444'825.00	0.01	
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	1'375 CHF	96.38%	1'325'225.00	0.04	
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	1'250 CHF	97.10%	1'213'750.00	0.04	
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	700 CHF	90.65%	634'550.00	0.02	
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'285 CHF	97.60%	1'254'160.00	0.04	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	1'500 CHF	97.90%	1'468'500.00	0.05	
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	500 CHF	99.54%	497'700.00	0.02	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	500 CHF	99.14%	495'700.00	0.02	
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	1'400 CHF	102.72%	1'438'080.00	0.05	
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	300 CHF	102.95%	308'850.00	0.01	
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	915 CHF	98.80%	904'020.00	0.03	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	1'000 CHF	103.00%	1'030'000.00	0.03	
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	22'250 CHF	95.57%	21'264'325.00	0.69	
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	22'178 CHF	93.28%	20'687'638.40	0.67	
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	13'621 CHF	114.25%	15'561'992.50	0.51	
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	50 CHF	98.85%	49'425.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	500 CHF	98.80%	494'000.00	0.02	
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	1'000 CHF	98.53%	985'300.00	0.03	
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	1'150 CHF	99.25%	1'141'375.00	0.04	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	1'225 CHF	97.65%	1'196'212.50	0.04	
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	500 CHF	96.95%	484'750.00	0.02	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	1'000 CHF	93.67%	936'700.00	0.03	
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	500 CHF	93.90%	469'500.00	0.02	
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	1'190 CHF	95.30%	1'134'070.00	0.04	
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	500 CHF	93.60%	468'000.00	0.02	
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	1'500 CHF	92.90%	1'393'500.00	0.05	
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	500 CHF	97.30%	486'500.00	0.02	
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	500 CHF	97.18%	485'900.00	0.02	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	200 CHF	96.45%	192'900.00	0.01	
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	500 CHF	99.65%	498'250.00	0.02	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	500 CHF	94.90%	474'500.00	0.02	
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	2'500 CHF	91.50%	2'287'500.00	0.07	
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	400 CHF	96.50%	386'000.00	0.01	
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	500 CHF	91.95%	459'750.00	0.01	
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	1'250 CHF	91.18%	1'139'750.00	0.04	
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	4'615 CHF	78.25%	3'611'237.50	0.12	
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	500 CHF	97.65%	488'250.00	0.02	
CH0488506665	0.0000 % PSPNSW 0 02/06/30	430 CHF	93.15%	400'545.00	0.01	
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.03	
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	500 CHF	98.75%	493'750.00	0.02	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	1'000 CHF	97.00%	970'000.00	0.03	
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	1'500 CHF	94.65%	1'419'750.00	0.05	
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	500 CHF	91.60%	458'000.00	0.01	
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	500 CHF	96.10%	480'500.00	0.02	
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	4'500 CHF	93.85%	4'223'250.00	0.14	
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'500 CHF	85.25%	2'131'250.00	0.07	
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	500 CHF	95.80%	479'000.00	0.02	
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	1'700 CHF	96.05%	1'632'850.00	0.05	
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	1'000 CHF	92.20%	922'000.00	0.03	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	1'000 CHF	93.97%	939'700.00	0.03	
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	2'500 CHF	91.40%	2'285'000.00	0.07	
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	500 CHF	93.75%	468'750.00	0.02	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	500 CHF	94.25%	471'250.00	0.02	
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	1'000 CHF	103.40%	1'034'000.00	0.03	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	200 CHF	91.85%	183'700.00	0.01	
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	920 CHF	98.30%	904'360.00	0.03	
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	1'800 CHF	94.89%	1'708'020.00	0.06	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	500 CHF	98.05%	490'250.00	0.02	
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	500 CHF	99.60%	498'000.00	0.02	
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.03	
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	1'500 CHF	95.04%	1'425'600.00	0.05	
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	855 CHF	99.20%	848'160.00	0.03	
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	1'380 CHF	98.10%	1'353'780.00	0.04	
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'050 CHF	92.65%	972'825.00	0.03	
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	500 CHF	90.55%	452'750.00	0.01	
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	500 CHF	83.30%	416'500.00	0.01	
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	1'500 CHF	91.56%	1'373'400.00	0.04	
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	700 CHF	97.03%	679'210.00	0.02	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	800 CHF	99.80%	798'400.00	0.03	
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	1'500 CHF	90.20%	1'353'000.00	0.04	
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	300 CHF	99.27%	297'810.00	0.01	
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	500 CHF	88.50%	442'500.00	0.01	
CH0553331825	0.5000 % BALHOL 0 1/2 12/16/30	1'000 CHF	95.50%	955'000.00	0.03	
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	2'000 CHF	87.31%	1'746'200.00	0.06	
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	16'733 CHF	97.84%	16'371'567.20	0.53	
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	14'494 CHF	113.96%	16'517'362.40	0.54	
CH0557779003	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47	6'235 CHF	108.80%	6'783'680.00	0.22	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	100 CHF	99.14%	99'140.00	0.00	
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	500 CHF	74.85%	374'250.00	0.01	
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	930 CHF	98.30%	914'190.00	0.03	
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	1'605 CHF	93.50%	1'500'675.00	0.05	
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	500 CHF	87.20%	436'000.00	0.01	
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	500 CHF	95.55%	477'750.00	0.02	
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	1'055 CHF	92.80%	979'040.00	0.03	
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	260 CHF	91.75%	238'550.00	0.01	
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	850 CHF	96.25%	818'125.00	0.03	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'300 CHF	96.35%	1'252'550.00	0.04	
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	500 CHF	98.00%	490'000.00	0.02	
CH0580464698	1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34	800 CHF	98.30%	786'400.00	0.03	
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'630 CHF	95.75%	2'518'225.00	0.08	
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	1'750 CHF	97.00%	1'697'500.00	0.06	
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	5'000 CHF	95.95%	4'797'500.00	0.16	
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	1'500 CHF	88.55%	1'328'250.00	0.04	
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	500 CHF	93.84%	469'200.00	0.02	
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	1'000 CHF	90.90%	909'000.00	0.03	
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	495 CHF	93.20%	461'340.00	0.02	
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	500 CHF	87.41%	437'050.00	0.01	
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	1'000 CHF	97.10%	971'000.00	0.03	
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	1'000 CHF	93.19%	931'900.00	0.03	
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	500 CHF	96.50%	482'500.00	0.02	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	4'700 CHF	94.35%	4'434'450.00	0.14	
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	500 CHF	89.53%	447'650.00	0.01	
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	1'400 CHF	93.30%	1'306'200.00	0.04	
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	1'000 CHF	96.00%	960'000.00	0.03	
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	1'060 CHF	96.30%	1'020'780.00	0.03	
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	2'100 CHF	98.25%	2'063'250.00	0.07	
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	500 CHF	95.25%	476'250.00	0.02	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	1'000 CHF	93.18%	931'800.00	0.03	
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	900 CHF	86.05%	774'450.00	0.03	
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	200 CHF	90.60%	181'200.00	0.01	
CH1129053828	0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40	600 CHF	85.40%	512'400.00	0.02	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'675 CHF	94.05%	1'575'337.50	0.05	
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	1'260 CHF	94.20%	1'186'920.00	0.04	
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	3'085 CHF	94.60%	2'918'410.00	0.10	
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	1'000 CHF	93.35%	933'500.00	0.03	
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	970 CHF	96.30%	934'110.00	0.03	
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	800 CHF	85.60%	684'800.00	0.02	
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	500 CHF	86.30%	431'500.00	0.01	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	500 CHF	94.57%	472'850.00	0.02	
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	1'000 CHF	96.66%	966'600.00	0.03	
CH1148266245	0.3000 % WKBNSW 0.3 02/07/30	950 CHF	95.45%	906'775.00	0.03	
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.03	
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	890 CHF	96.35%	857'515.00	0.03	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'500 CHF	94.15%	1'412'250.00	0.05	
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	900 CHF	96.45%	868'050.00	0.03	
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	1'700 CHF	98.00%	1'666'000.00	0.05	
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	450 CHF	97.63%	439'335.00	0.01	
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	250 CHF	93.35%	233'375.00	0.01	
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	45 CHF	96.46%	43'407.00	0.00	
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	1'000 CHF	91.80%	918'000.00	0.03	
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	2'870 CHF	98.40%	2'824'080.00	0.09	
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	1'000 CHF	96.95%	969'500.00	0.03	
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	500 CHF	98.44%	492'200.00	0.02	
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	2'300 CHF	99.20%	2'281'600.00	0.07	
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	300 CHF	99.20%	297'600.00	0.01	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	1'000 CHF	98.89%	988'900.00	0.03	
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	2'000 CHF	100.05%	2'001'000.00	0.07	
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	1'000 CHF	100.50%	1'005'000.00	0.03	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	1'000 CHF	106.83%	1'068'300.00	0.03	
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'000 CHF	100.10%	1'001'000.00	0.03	
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	950 CHF	104.05%	988'475.00	0.03	
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	1'000 CHF	99.60%	996'000.00	0.03	
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	925 CHF	99.50%	920'375.00	0.03	
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	550 CHF	99.80%	548'900.00	0.02	
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	500 CHF	105.35%	526'750.00	0.02	
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	1'200 CHF	105.08%	1'260'960.00	0.04	
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	1'000 CHF	116.50%	1'165'000.00	0.04	
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	1'200 CHF	102.40%	1'228'800.00	0.04	
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'000 CHF	101.95%	1'019'500.00	0.03	
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	500 CHF	108.15%	540'750.00	0.02	
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	1'000 CHF	102.53%	1'025'300.00	0.03	
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	750 CHF	101.95%	764'625.00	0.02	
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	1'500 CHF	111.05%	1'665'750.00	0.05	
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	750 CHF	104.45%	783'375.00	0.03	
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	650 CHF	106.74%	693'810.00	0.02	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	1'000 CHF	116.02%	1'160'200.00	0.04	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	500 CHF	109.03%	545'150.00	0.02	
CH1214797198	2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30	500 CHF	106.30%	531'500.00	0.02	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	1'960 CHF	103.30%	2'024'680.00	0.07	
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	500 CHF	104.05%	520'250.00	0.02	
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	500 CHF	100.68%	503'400.00	0.02	
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	200 CHF	100.94%	201'880.00	0.01	
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	1'360 CHF	104.25%	1'417'800.00	0.05	
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	1'500 CHF	107.19%	1'607'850.00	0.05	
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	800 CHF	101.25%	810'000.00	0.03	
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	500 CHF	103.25%	516'250.00	0.02	
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	1'000 CHF	101.31%	1'013'100.00	0.03	
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	400 CHF	123.75%	495'000.00	0.02	
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	345 CHF	105.35%	363'457.50	0.01	
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	1'000 CHF	103.64%	1'036'400.00	0.03	
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	1'680 CHF	103.90%	1'745'520.00	0.06	
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	2'500 CHF	103.05%	2'576'250.00	0.08	
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	500 CHF	105.50%	527'500.00	0.02	
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	500 CHF	104.10%	520'500.00	0.02	
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	100 CHF	109.35%	109'350.00	0.00	
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	550 CHF	101.70%	559'350.00	0.02	
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	1'745 CHF	104.45%	1'822'652.50	0.06	
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	3'200 CHF	108.01%	3'456'320.00	0.11	
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	1'000 CHF	106.00%	1'060'000.00	0.03	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.03
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	1'000 CHF	103.45%	1'034'500.00	0.03
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	500 CHF	115.70%	578'500.00	0.02
CH1265890801	1.6000 % KBBS 1.6 06/24/31 004	500 CHF	103.50%	517'500.00	0.02
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	915 CHF	110.55%	1'011'532.50	0.03
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	1'000 CHF	102.92%	1'029'200.00	0.03
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	800 CHF	105.85%	846'800.00	0.03
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	500 CHF	101.50%	507'500.00	0.02
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	700 CHF	105.63%	739'410.00	0.02
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	980 CHF	104.16%	1'020'768.00	0.03
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	1'100 CHF	104.80%	1'152'800.00	0.04
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	1'255 CHF	102.75%	1'289'512.50	0.04
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	700 CHF	104.50%	731'500.00	0.02
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	2'000 CHF	120.65%	2'413'000.00	0.08
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	1'100 CHF	105.30%	1'158'300.00	0.04
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	500 CHF	106.15%	530'750.00	0.02
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	1'000 CHF	114.75%	1'147'500.00	0.04
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	500 CHF	106.60%	533'000.00	0.02
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	1'500 CHF	106.42%	1'596'300.00	0.05
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	700 CHF	116.85%	817'950.00	0.03
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	760 CHF	105.30%	800'280.00	0.03
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	500 CHF	102.95%	514'750.00	0.02
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	800 CHF	105.05%	840'400.00	0.03
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	1'000 CHF	106.90%	1'069'000.00	0.03
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	1'000 CHF	103.45%	1'034'500.00	0.03
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	2'450 CHF	99.40%	2'435'300.00	0.08
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	2'195 CHF	101.75%	2'233'412.50	0.07
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	100 CHF	107.40%	107'400.00	0.00
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	500 CHF	107.40%	537'000.00	0.02
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	300 CHF	107.60%	322'800.00	0.01
CH1293714361	2.3750 % INSBER 2 3/8 09/29/31	670 CHF	105.45%	706'515.00	0.02
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	500 CHF	110.45%	552'250.00	0.02
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	625 CHF	106.00%	662'500.00	0.02
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	100 CHF	102.05%	102'050.00	0.00
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	550 CHF	102.10%	561'550.00	0.02
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	1'000 CHF	103.20%	1'032'000.00	0.03
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	850 CHF	105.50%	896'750.00	0.03
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	870 CHF	101.51%	883'137.00	0.03
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	1'000 CHF	102.87%	1'028'700.00	0.03
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	1'100 CHF	103.90%	1'142'900.00	0.04
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	500 CHF	101.50%	507'500.00	0.02
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	500 CHF	101.75%	508'750.00	0.02
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	1'650 CHF	103.10%	1'701'150.00	0.06
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	1'000 CHF	103.34%	1'033'400.00	0.03
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	1'500 CHF	104.45%	1'566'750.00	0.05
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	1'000 CHF	101.80%	1'018'000.00	0.03
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	1'400 CHF	105.57%	1'477'980.00	0.05
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.03
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	2'625 CHF	107.48%	2'821'350.00	0.09
CH1325037054	1.3000 % NEUNBG 1.3 06/12/48	1'000 CHF	110.05%	1'100'500.00	0.04
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	500 CHF	124.55%	622'750.00	0.02
CH1337248962	1.6500 % PSPNSW 1.65 10/11/32	850 CHF	101.70%	864'450.00	0.03
CH1337248988	2.1175 % RAIFFS 2.1175 05/14/32	500 CHF	103.15%	515'750.00	0.02
CH1337249044	1.1500 % KTBL 1.15 06/24/33	500 CHF	103.50%	517'500.00	0.02
CH1341034986	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/24/54 754	500 CHF	111.20%	556'000.00	0.02
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	1'000 CHF	102.80%	1'028'000.00	0.03
CH1344316760	1.6250 % NESNVX 1 5/8 05/30/34	3'425 CHF	104.25%	3'570'562.50	0.12
CH1346742856	2.1000 % KSAARA 2.1 05/15/34	250 CHF	104.60%	261'500.00	0.01
CH1346742914	2.4000 % SGKNSW 2.4 05/30/34	1'000 CHF	105.00%	1'050'000.00	0.03
CH1346742989	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 594	1'300 CHF	103.74%	1'348'620.00	0.04
CH1346743011	1.8500 % WASSER 1.85 07/01/38	500 CHF	107.45%	537'250.00	0.02

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH1346743029	2.0500 % MOBNSW 2.05 07/01/30	500 CHF	102.90%	514'500.00	0.02	
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	900 CHF	101.10%	909'900.00	0.03	
CH1348614046	1.8000 % BARY 1.8 05/15/26	1'000 CHF	100.70%	1'007'000.00	0.03	
CH1348614145	1.7500 % BALHOL 1 3/4 06/07/34	1'000 CHF	103.10%	1'031'000.00	0.03	
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	1'600 CHF	102.45%	1'639'200.00	0.05	
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	950 CHF	102.05%	969'475.00	0.03	
CH1349191804	1.6000 % BCG 1.6 06/10/30	500 CHF	102.35%	511'750.00	0.02	
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	500 CHF	101.25%	506'250.00	0.02	
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.03	
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	500 CHF	101.73%	508'650.00	0.02	
CH1361401719	1.2500 % PFZENT 1 1/4 04/19/33 596	1'500 CHF	101.84%	1'527'600.00	0.05	
CH1361401727	1.3000 % PFZENT 1.3 11/14/39 597	1'400 CHF	103.33%	1'446'620.00	0.05	
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	810 CHF	101.25%	820'125.00	0.03	
CH1361401743	1.4000 % IWBBAS 1.4 07/13/34	950 CHF	102.20%	970'900.00	0.03	
CH1361401842	1.1250 % ZKB 1 1/8 08/16/34 158	1'500 CHF	100.20%	1'503'000.00	0.05	
CH1371736757	1.0000 % PSHYPO 1 06/07/33 759	500 CHF	99.81%	499'050.00	0.02	

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

EUR 1 = CHF 0.93915344

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	39'721'165.35	3.899
Bank account	CHF	5'008.05	0.000
Bond	CHF	978'306'317.24	96.019
Equity	CHF	839'398.77	0.082
Total	CHF	1'018'871'889.41	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.203	-	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.203	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.203	-	-	-

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	953'535'975.10
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
FA CHF	0.160	0.500	0.060	0.100	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000

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

9 Benchmark

SBI® Domestic AAA-BBB TR

10 TER

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

11 Fussnoten

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

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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