

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB FOREIGN 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
DT CHF	11704513	CHF
FA CHF	31562126	CHF
GT CHF	31562310	CHF
NT CHF	11704512	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	21
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	21
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	22
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	22
8	Pauschale Verwaltungskommission	23
9	Benchmark	23
10	TER	23
11	Fussnoten	24
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	25

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		756'286'523.58	987'324'918.14	1'063'840'970.80	1'162'830'461.47
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'374'429.49	36'712'353.79	147'509'277.97	158'806'645.64
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		87'961.045	352'600.723	1'480'142.913	1'502'985.913
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		106.5748	104.1188	99.6588	105.6608
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		113.4796	109.2671	100.2649	102.5351
Thesaurierung je Anteil		-	1.02	0.69	0.71
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'162'349.75	1'064'095.65	1'266'172.18	750'763.71
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'103.581	12'201.474	15'079.251	8'393.800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		88.7047	87.2104	83.9678	89.4426
Ausschüttung je Anteil		-	0.85	0.70	0.60
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'663'412.79	1'320'411.54	1'484'809.37	3'110'081.95
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		17'477.727	14'201.485	16'686.485	32'970.130
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.1733	92.9770	88.9828	94.3303
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		101.3394	97.5744	89.5239	91.5398
Thesaurierung je Anteil		-	0.92	0.63	0.65
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		744'086'331.55	948'228'057.16	913'580'711.28	1'000'162'970.17
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'866'360.526	8'958'900.770	9'027'207.933	9'330'422.573
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		108.3669	105.8420	101.2030	107.1937
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		115.3879	111.0755	101.8185	104.0227
Thesaurierung je Anteil		-	1.20	0.86	0.90
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	2.71 %	5.27 %	-9.70 %	-0.83 %
Klasse FA CHF	2.71 %	5.27 %	-9.70 %	-0.83 %
Klasse GT CHF	2.72 %	5.29 %	-9.68 %	-0.81 %
Klasse NT CHF	2.79 %	5.44 %	-9.56 %	-0.67 %
Benchmark	2.71 %	5.23 %	-9.38 %	-0.72 %
Tracking Error 33)	-	0.08 %	0.34 %	0.03 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	-
Klasse FA CHF	-
Klasse GT CHF	0.01 %
Klasse NT CHF	0.08 %

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	2'000'746.11	4'105'346.35
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	749'436'619.83	977'512'658.43
Sonstige Vermögenswerte	4'850'735.72	5'713'510.38
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	756'288'101.66	987'331'515.16
Andere Verbindlichkeiten	-1'578.08	-6'597.02
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	756'286'523.58	987'324'918.14

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		352'600.723	1'480'142.913
Ausgegebene Anteile		11'474.000	123'250.810
Zurückgenommene Anteile		-276'113.678	-1'250'793.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		87'961.045	352'600.723
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'201.474	15'079.251
Ausgegebene Anteile		1'049.000	1'594.695
Zurückgenommene Anteile		-146.893	-4'472.472
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'103.581	12'201.474
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'201.485	16'686.485
Ausgegebene Anteile		5'680.000	1'330.000
Zurückgenommene Anteile		-2'403.758	-3'815.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		17'477.727	14'201.485
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'958'900.770	9'027'207.933
Ausgegebene Anteile		226'471.236	1'441'705.306
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	18'573.851
Zurückgenommene Anteile		-270'626.393	-1'036'878.265
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-2'048'385.087	-491'708.055
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		6'866'360.526	8'958'900.770

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	26.06.2024	109'443'993.60	1'024'000.000
Klasse NT CHF	11.07.2024	109'855'261.61	1'024'385.087

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		987'324'918.14	1'063'840'970.80
Ausbezahlte Ausschüttung		-11'064.81	-10'070.44
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'815'274.60	-3'004'307.27
Saldo aus dem Anteilverkehr		-250'248'664.52	-122'804'933.94
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		23'036'609.37	49'303'258.99
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		756'286'523.58	987'324'918.14

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		26'273.04	42'719.75
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		5'878'266.38	12'037'746.66
Erträge aus Wertpapierleihe		110'576.70	245'690.45
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		45'128.99	644'177.17
Total Ertrag		6'060'245.11	12'970'334.03
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-12'568.75	-205'781.19
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'121'367.88	-1'609'624.92
Total Aufwand		-1'133'936.63	-1'815'406.11
Nettoertrag / Verlust		4'926'308.48	11'154'927.92
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-7'189'601.09	-19'135'625.59
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		90'526.65	586'307.64
Realisierter Erfolg		-2'172'765.96	-7'394'390.03
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		25'209'375.33	56'697'649.02
Gesamterfolg		23'036'609.37	49'303'258.99

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							749'436'619.83	99.09	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							749'436'619.83	99.09	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	9'535	600	2'960	7'175 CHF	111.05%	7'967'837.50	1.05	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	5'935	0	5'935	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	9'930	0	4'215	5'715 CHF	101.60%	5'806'440.00	0.77	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	3'450	0	1'140	2'310 CHF	108.85%	2'514'435.00	0.33	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'950	0	150	1'800 CHF	103.00%	1'854'000.00	0.25	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	2'370	0	200	2'170 CHF	116.05%	2'518'285.00	0.33	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	6'125	0	1'645	4'480 CHF	125.75%	5'633'600.00	0.74	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'550	0	330	1'220 CHF	126.40%	1'542'080.00	0.20	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	3'910	0	855	3'055 CHF	111.35%	3'401'742.50	0.45	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNAV 3 3/8 08/15/31 EMTN	3'100	0	900	2'200 CHF	115.30%	2'536'600.00	0.34	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	4'000	0	870	3'130 CHF	104.05%	3'256'765.00	0.43	a)
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	1'300	0	405	895 CHF	113.55%	1'016'272.50	0.13	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	5'220	0	1'570	3'650 CHF	113.80%	4'153'700.00	0.55	a)
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'575	0	200	1'375 CHF	122.35%	1'682'312.50	0.22	a)
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	930	0	150	780 CHF	128.55%	1'002'690.00	0.13	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	1'900	200	685	1'415 CHF	108.05%	1'528'907.50	0.20	a)
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	1'760	0	400	1'360 CHF	110.60%	1'504'160.00	0.20	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	1'000	0	335	665 CHF	105.15%	699'247.50	0.09	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	800	0	200	600 CHF	103.35%	620'100.00	0.08	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	850	0	0	850 CHF	106.30%	903'550.00	0.12	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	1'385	0	300	1'085 CHF	102.15%	1'108'327.50	0.15	a)
CH0119533278	3.1250 % UBS 3 1/8 11/12/30 EMTN	1'080	0	285	795 CHF	109.20%	868'140.00	0.11	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'295	0	495	800 CHF	101.65%	813'200.00	0.11	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	1'330	0	200	1'130 CHF	109.60%	1'238'480.00	0.16	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	1'310	0	0	1'310 CHF	116.25%	1'522'875.00	0.20	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	1'380	0	150	1'230 CHF	102.30%	1'258'290.00	0.17	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	3'100	0	1'295	1'805 CHF	101.35%	1'829'367.50	0.24	a)
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	1'905	0	700	1'205 CHF	101.40%	1'221'870.00	0.16	a)
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	1'705	0	720	985 CHF	101.45%	999'282.50	0.13	a)
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	1'100	0	350	750 CHF	108.85%	816'375.00	0.11	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	2'300	200	190	2'310 CHF	102.15%	2'359'665.00	0.31	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'100	200	300	1'000 CHF	108.25%	1'082'500.00	0.14	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	1'550	0	500	1'050 CHF	100.67%	1'057'035.00	0.14	a)
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	1'100	0	375	725 CHF	99.90%	724'275.00	0.10	a)
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'080	0	0	2'080 CHF	100.05%	2'081'040.00	0.28	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	900	120	0	1'020 CHF	98.75%	1'007'250.00	0.13	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	1'950	0	350	1'600 CHF	100.20%	1'603'200.00	0.21	a)
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	1'335	0	445	890 CHF	104.65%	931'385.00	0.12	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	3'060	0	200	2'860 CHF	98.88%	2'827'968.00	0.37	a)
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	3'230	0	980	2'250 CHF	98.75%	2'221'875.00	0.29	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	1'845	0	790	1'055 CHF	99.96%	1'054'578.00	0.14	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	1'700	0	450	1'250 CHF	98.65%	1'233'125.00	0.16	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	1'760	0	655	1'105 CHF	99.40%	1'098'370.00	0.15	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	4'590	0	1'365	3'225 CHF	99.60%	3'212'100.00	0.42	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'000	0	500	500 CHF	100.82%	504'100.00	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.
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	5'000	0	1'495	3'505 CHF	100.75%	3'531'287.50	0.47	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'250	0	725	1'525 CHF	99.07%	1'510'817.50	0.20	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'500	0	490	1'010 CHF	98.98%	999'698.00	0.13	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	1'900	120	620	1'400 CHF	98.70%	1'381'800.00	0.18	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	3'475	0	1'370	2'105 CHF	98.84%	2'080'582.00	0.28	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	1'900	0	630	1'270 CHF	100.25%	1'273'175.00	0.17	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	1'750	0	545	1'205 CHF	98.75%	1'189'937.50	0.16	a)
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	98.40%	787'200.00	0.10	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'500	0	295	1'205 CHF	98.75%	1'189'937.50	0.16	a)
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	3'430	0	1'020	2'410 CHF	98.55%	2'375'055.00	0.31	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'000	0	300	700 CHF	98.75%	691'250.00	0.09	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'125	0	250	875 CHF	96.60%	845'250.00	0.11	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	900	0	300	600 CHF	98.05%	588'300.00	0.08	a)
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	1'400	0	485	915 CHF	95.00%	869'250.00	0.11	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	1'425	0	455	970 CHF	98.70%	957'390.00	0.13	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	1'300	0	290	1'010 CHF	97.05%	980'205.00	0.13	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	3'465	0	550	2'915 CHF	94.40%	2'751'760.00	0.36	a)
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	2'695	0	850	1'845 CHF	99.13%	1'828'948.50	0.24	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	2'600	0	450	2'150 CHF	97.00%	2'085'500.00	0.28	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	2'155	0	630	1'525 CHF	98.91%	1'508'377.50	0.20	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'750	0	750	1'000 CHF	99.21%	992'100.00	0.13	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	1'550	0	505	1'045 CHF	98.95%	1'034'027.50	0.14	a)
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	600	0	0	600 CHF	97.50%	585'000.00	0.08	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	1'500	0	150	1'350 CHF	96.50%	1'302'750.00	0.17	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	1'550	0	810	740 CHF	96.00%	710'400.00	0.09	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'100	0	300	800 CHF	97.50%	780'000.00	0.10	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	3'450	0	1'025	2'425 CHF	99.60%	2'415'300.00	0.32	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	3'650	0	700	2'950 CHF	96.80%	2'855'600.00	0.38	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	2'250	0	715	1'535 CHF	99.20%	1'522'720.00	0.20	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'600	0	380	1'220 CHF	99.60%	1'215'120.00	0.16	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'145	150	980	1'315 CHF	97.85%	1'286'727.50	0.17	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	2'150	120	500	1'770 CHF	96.70%	1'711'590.00	0.23	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	98.45%	1'181'400.00	0.16	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	800	0	235	565 CHF	99.27%	560'875.50	0.07	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	4'850	0	1'405	3'445 CHF	97.85%	3'370'932.50	0.45	a)
CH0383104343	0.5500 % NESNVX 0.55 10/04/32 EMTN	1'250	0	370	880 CHF	96.45%	848'760.00	0.11	a)
CH038518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'000	200	1'270	2'930 CHF	98.40%	2'883'120.00	0.38	a)
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	2'750	0	905	1'845 CHF	96.85%	1'786'882.50	0.24	a)
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	1'400	0	450	950 CHF	96.00%	912'000.00	0.12	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	2'200	0	600	1'600 CHF	98.00%	1'568'000.00	0.21	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'400	0	900	1'500 CHF	99.09%	1'486'350.00	0.20	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	1'550	0	630	920 CHF	92.35%	849'620.00	0.11	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	1'750	0	545	1'205 CHF	97.85%	1'179'092.50	0.16	a)
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	750	0	0	750 CHF	98.90%	741'750.00	0.10	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	1'750	0	545	1'205 CHF	99.04%	1'193'432.00	0.16	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'700	0	495	1'205 CHF	98.65%	1'188'732.50	0.16	a)
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'800	0	505	1'295 CHF	99.65%	1'290'467.50	0.17	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	1'615	0	1'615	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	2'850	0	845	2'005 CHF	99.75%	1'999'987.50	0.26	a)
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	3'350	250	995	2'605 CHF	98.10%	2'555'505.00	0.34	a)
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	900	0	340	560 CHF	95.25%	533'400.00	0.07	a)
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	1'400	0	600	800 CHF	96.90%	775'200.00	0.10	a)
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'350	0	200	1'150 CHF	96.10%	1'105'150.00	0.15	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	620	0	0	620 CHF	98.65%	611'630.00	0.08	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	3'480	0	995	2'485 CHF	98.45%	2'446'482.50	0.32	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.
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	1'750	0	545	1'205 CHF	98.80%	1'190'540.00	0.16	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'300	0	380	920 CHF	98.00%	901'600.00	0.12	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	800	0	250	550 CHF	99.70%	548'350.00	0.07	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	800	0	200	600 CHF	99.10%	594'600.00	0.08	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	7'850	0	2'600	5'250 CHF	99.05%	5'200'125.00	0.69	a)
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	1'650	0	465	1'185 CHF	99.73%	1'181'800.50	0.16	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'100	0	375	725 CHF	97.60%	707'600.00	0.09	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	3'100	0	800	2'300 CHF	97.50%	2'242'500.00	0.30	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	3'450	150	965	2'635 CHF	98.25%	2'588'887.50	0.34	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	860	0	860	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	2'250	0	500	1'750 CHF	96.85%	1'694'875.00	0.22	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	1'350	0	200	1'150 CHF	95.75%	1'101'125.00	0.15	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	950	0	325	625 CHF	96.80%	605'000.00	0.08	a)
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	900	0	200	700 CHF	93.65%	655'550.00	0.09	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	1'100	0	365	735 CHF	97.05%	713'317.50	0.09	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	950	0	200	750 CHF	92.65%	694'875.00	0.09	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	1'200	0	200	1'000 CHF	87.80%	878'000.00	0.12	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	2'580	0	755	1'825 CHF	96.00%	1'752'000.00	0.23	a)
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	700	0	200	500 CHF	95.15%	475'750.00	0.06	a)
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	2'240	0	685	1'555 CHF	98.85%	1'537'117.50	0.20	a)
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	1'200	0	400	800 CHF	99.72%	797'760.00	0.11	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	2'650	0	805	1'845 CHF	99.50%	1'835'775.00	0.24	a)
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	1'850	0	200	1'650 CHF	98.45%	1'624'425.00	0.21	a)
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	1'855	0	1'855	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	5'700	150	1'615	4'235 CHF	97.40%	4'124'890.00	0.55	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'800	0	480	1'320 CHF	95.75%	1'263'900.00	0.17	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	800	0	0	800 CHF	96.15%	769'200.00	0.10	a)
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'250	0	200	1'050 CHF	98.83%	1'037'715.00	0.14	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	3'150	0	450	2'700 CHF	98.50%	2'659'500.00	0.35	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'300	0	480	820 CHF	98.85%	810'570.00	0.11	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	950	0	150	800 CHF	98.40%	787'200.00	0.10	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	3'090	150	900	2'340 CHF	95.95%	2'245'230.00	0.30	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'450	0	540	910 CHF	94.20%	857'220.00	0.11	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	96.85%	1'162'200.00	0.15	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	2'300	200	655	1'845 CHF	94.50%	1'743'525.00	0.23	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	1'800	0	600	1'200 CHF	96.00%	1'152'000.00	0.15	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'000	0	635	1'365 CHF	97.30%	1'328'145.00	0.18	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	1'750	150	545	1'355 CHF	97.75%	1'324'512.50	0.18	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	3'450	0	965	2'485 CHF	98.94%	2'458'659.00	0.33	a)
CH0483180961	0.6250 % ORAFP 0 5/8 06/22/29 EMTN	850	0	290	560 CHF	97.50%	546'000.00	0.07	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHPW 0.05 07/19/27 EMTN	900	0	300	600 CHF	95.95%	575'700.00	0.08	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	1'345	0	180	1'165 CHF	94.05%	1'095'682.50	0.14	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	2'010	0	250	1'760 CHF	93.35%	1'642'960.00	0.22	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	900	0	0	900 CHF	93.15%	838'350.00	0.11	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	900	0	355	545 CHF	93.55%	509'847.50	0.07	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	3'250	200	1'135	2'315 CHF	97.70%	2'261'755.00	0.30	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	1'200	0	400	800 CHF	97.65%	781'200.00	0.10	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	1'300	0	290	1'010 CHF	95.50%	964'550.00	0.13	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	800	0	250	550 CHF	97.75%	537'625.00	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.
CH0503144393	0.2500 % BFCM 0 1/4 10/24/29 EMTN	850	0	250	600 CHF	94.65%	567'900.00	0.08	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	2'860	0	855	2'005 CHF	97.05%	1'945'852.50	0.26	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	950	0	450	500 CHF	98.73%	493'650.00	0.07	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'000	0	555	1'445 CHF	97.00%	1'401'650.00	0.19	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	700	0	0	700 CHF	98.25%	687'750.00	0.09	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	1'600	0	600	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.13	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.13	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'000	0	400	600 CHF	98.15%	588'900.00	0.08	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	850	0	290	560 CHF	96.55%	540'680.00	0.07	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	1'400	300	200	1'500 CHF	94.65%	1'419'750.00	0.19	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	2'600	0	680	1'920 CHF	94.35%	1'811'520.00	0.24	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	1'150	0	315	835 CHF	96.00%	801'600.00	0.11	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	1'500	0	400	1'100 CHF	95.60%	1'051'600.00	0.14	a)
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	1'540	150	340	1'350 CHF	95.80%	1'293'300.00	0.17	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	2'200	0	600	1'600 CHF	98.64%	1'578'240.00	0.21	a)
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	2'700	0	200	2'500 CHF	94.70%	2'367'500.00	0.31	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	1'400	0	400	1'000 CHF	96.85%	968'500.00	0.13	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	95.50%	1'146'000.00	0.15	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	1'450	0	505	945 CHF	95.90%	906'255.00	0.12	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	2'850	0	700	2'150 CHF	92.45%	1'987'675.00	0.26	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	1'600	0	555	1'045 CHF	98.05%	1'024'622.50	0.14	a)
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	1'400	0	400	1'000 CHF	97.65%	976'500.00	0.13	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	92.55%	1'018'050.00	0.13	a)
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.55%	1'951'000.00	0.26	a)
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	850	0	0	850 CHF	93.80%	797'300.00	0.11	a)
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	1'820	0	1'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	850	0	200	650 CHF	100.00%	650'000.00	0.09	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'700	0	550	1'150 CHF	98.30%	1'130'450.00	0.15	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'670	0	620	1'050 CHF	96.55%	1'013'775.00	0.13	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	1'350	0	405	945 CHF	94.50%	893'025.00	0.12	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	1'540	0	1'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	2'620	0	780	1'840 CHF	94.90%	1'746'160.00	0.23	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	1'600	200	600	1'200 CHF	98.05%	1'176'600.00	0.16	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	3'300	0	1'580	1'720 CHF	99.54%	1'712'088.00	0.23	a)
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	1'800	0	575	1'225 CHF	97.30%	1'191'925.00	0.16	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	925	0	925	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	2'615	0	820	1'795 CHF	95.75%	1'718'712.50	0.23	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	1'600	0	370	1'230 CHF	96.20%	1'183'260.00	0.16	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	3'150	200	925	2'425 CHF	95.05%	2'304'962.50	0.30	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	1'945	0	200	1'745 CHF	99.25%	1'731'912.50	0.23	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	2'200	150	550	1'800 CHF	95.80%	1'724'400.00	0.23	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	1'290	0	390	900 CHF	98.99%	890'910.00	0.12	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	2'400	0	900	1'500 CHF	99.55%	1'493'250.00	0.20	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'720	0	200	1'520 CHF	97.25%	1'478'200.00	0.20	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	3'600	0	1'035	2'565 CHF	88.65%	2'273'872.50	0.30	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	800	0	200	600 CHF	96.10%	576'600.00	0.08	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'200	0	400	800 CHF	95.75%	766'000.00	0.10	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	94.85%	1'517'600.00	0.20	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'300	0	200	2'100 CHF	96.80%	2'032'800.00	0.27	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'620	0	200	1'420 CHF	97.40%	1'383'080.00	0.18	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'550	0	380	1'170 CHF	83.50%	976'950.00	0.13	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	1'250	0	725	525 CHF	85.90%	450'975.00	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.
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.20%	777'600.00	0.10	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	1'300	0	340	960 CHF	92.45%	887'520.00	0.12	a)
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'100	0	295	805 CHF	93.75%	754'687.50	0.10	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'200	0	360	840 CHF	93.15%	782'460.00	0.10	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	2'050	0	740	1'310 CHF	94.80%	1'241'880.00	0.16	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	1'900	0	645	1'255 CHF	86.85%	1'089'967.50	0.14	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	1'900	0	300	1'600 CHF	99.25%	1'588'000.00	0.21	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	3'300	0	1'055	2'245 CHF	96.35%	2'163'057.50	0.29	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	2'850	0	850	2'000 CHF	95.20%	1'904'000.00	0.25	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	4'120	0	1'240	2'880 CHF	94.10%	2'710'080.00	0.36	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	1'650	0	450	1'200 CHF	95.85%	1'150'200.00	0.15	a)
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.05%	1'841'000.00	0.24	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	3'900	0	1'095	2'805 CHF	96.95%	2'719'447.50	0.36	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	4'100	0	1'120	2'980 CHF	96.75%	2'883'150.00	0.38	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	97.90%	1'174'800.00	0.16	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	1'300	0	340	960 CHF	96.75%	928'800.00	0.12	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	2'200	0	600	1'600 CHF	97.15%	1'554'400.00	0.21	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	1'380	0	300	1'080 CHF	95.20%	1'028'160.00	0.14	a)
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	2'300	0	400	1'900 CHF	93.90%	1'784'100.00	0.24	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	1'400	0	520	880 CHF	95.00%	836'000.00	0.11	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'350	0	470	880 CHF	96.00%	844'800.00	0.11	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'800	0	830	1'970 CHF	96.50%	1'901'050.00	0.25	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	2'350	0	850	1'500 CHF	96.40%	1'446'000.00	0.19	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	900	0	200	700 CHF	97.45%	682'150.00	0.09	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	1'800	0	525	1'275 CHF	93.35%	1'190'212.50	0.16	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	2'200	0	515	1'685 CHF	97.30%	1'639'505.00	0.22	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	2'350	0	700	1'650 CHF	94.45%	1'558'425.00	0.21	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	2'300	0	795	1'505 CHF	93.75%	1'410'937.50	0.19	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	87.80%	702'400.00	0.09	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	2'000	0	200	1'800 CHF	97.05%	1'746'900.00	0.23	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	2'150	0	630	1'520 CHF	95.05%	1'444'760.00	0.19	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	93.90%	1'032'900.00	0.14	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	96.25%	1'203'125.00	0.16	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	95.15%	761'200.00	0.10	a)
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	1'700	0	460	1'240 CHF	93.05%	1'153'820.00	0.15	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	2'000	0	600	1'400 CHF	97.00%	1'358'000.00	0.18	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	1'700	0	300	1'400 CHF	90.25%	1'263'500.00	0.17	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	95.95%	1'631'150.00	0.22	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	94.80%	1'137'600.00	0.15	a)
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'400	0	485	915 CHF	94.85%	867'877.50	0.11	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	2'500	300	745	2'055 CHF	94.60%	1'944'030.00	0.26	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	1'400	0	445	955 CHF	96.45%	921'097.50	0.12	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	2'570	0	795	1'775 CHF	95.75%	1'699'562.50	0.22	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	1'000	0	375	625 CHF	97.15%	607'187.50	0.08	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	2'450	150	810	1'790 CHF	95.30%	1'705'870.00	0.23	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	1'550	0	665	885 CHF	95.60%	846'060.00	0.11	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	850	0	300	550 CHF	95.45%	524'975.00	0.07	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	800	0	150	650 CHF	97.15%	631'475.00	0.08	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	3'100	0	1'000	2'100 CHF	97.80%	2'053'800.00	0.27	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	1'150	0	0	1'150 CHF	97.15%	1'117'225.00	0.15	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	1'750	0	150	1'600 CHF	97.65%	1'562'400.00	0.21	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	2'000	0	800	1'200 CHF	96.70%	1'160'400.00	0.15	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	1'600	0	600	1'000 CHF	106.35%	1'063'500.00	0.14	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	1'900	0	760	1'140 CHF	97.65%	1'113'210.00	0.15	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'350	0	250	1'100 CHF	94.35%	1'037'850.00	0.14	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'480	0	360	1'120 CHF	96.20%	1'077'440.00	0.14	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	3'290	0	1'080	2'210 CHF	96.10%	2'123'810.00	0.28	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.
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	2'600	0	800	1'800 CHF	97.30%	1'751'400.00	0.23	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	2'400	0	600	1'800 CHF	94.25%	1'696'500.00	0.22	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	1'700	0	200	1'500 CHF	97.50%	1'462'500.00	0.19	a)
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	2'200	0	550	1'650 CHF	96.20%	1'587'300.00	0.21	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'550	0	320	1'230 CHF	95.95%	1'180'185.00	0.16	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'750	0	575	1'175 CHF	96.45%	1'133'287.50	0.15	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	1'750	0	615	1'135 CHF	93.90%	1'065'765.00	0.14	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	1'900	0	200	1'700 CHF	94.50%	1'606'500.00	0.21	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	95.60%	1'147'200.00	0.15	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	2'700	0	690	2'010 CHF	97.85%	1'966'785.00	0.26	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'000	0	1'300	1'700 CHF	97.75%	1'661'750.00	0.22	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	1'050	120	330	840 CHF	95.50%	802'200.00	0.11	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	1'600	0	400	1'200 CHF	96.45%	1'157'400.00	0.15	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	1'400	200	405	1'195 CHF	97.90%	1'169'905.00	0.15	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	800	0	200	600 CHF	96.15%	576'900.00	0.08	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	1'700	0	495	1'205 CHF	97.50%	1'174'875.00	0.16	a)
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	800	150	240	710 CHF	96.65%	686'215.00	0.09	a)
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	1'800	0	595	1'205 CHF	99.70%	1'201'385.00	0.16	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	1'200	200	400	1'000 CHF	98.70%	987'000.00	0.13	a)
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	800	0	0	800 CHF	97.05%	776'400.00	0.10	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	950	150	0	1'100 CHF	98.40%	1'082'400.00	0.14	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	98.75%	1'234'375.00	0.16	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	2'305	0	0	2'305 CHF	98.20%	2'263'510.00	0.30	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'100	0	500	600 CHF	98.35%	590'100.00	0.08	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	2'550	0	260	2'290 CHF	98.75%	2'261'375.00	0.30	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	1'850	0	550	1'300 CHF	98.75%	1'283'750.00	0.17	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'250	0	205	1'045 CHF	98.55%	1'029'847.50	0.14	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	900	0	315	585 CHF	98.95%	578'857.50	0.08	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	1'300	0	415	885 CHF	100.10%	885'885.00	0.12	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	550	0	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	850	0	0	850 CHF	98.70%	838'950.00	0.11	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	2'250	0	685	1'565 CHF	99.40%	1'555'610.00	0.21	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	1'975	0	150	1'825 CHF	99.60%	1'817'700.00	0.24	a)
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	1'750	200	600	1'350 CHF	99.80%	1'347'300.00	0.18	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	1'400	0	500	900 CHF	100.80%	907'200.00	0.12	a)
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	1'700	200	570	1'330 CHF	100.95%	1'342'635.00	0.18	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	1'800	0	595	1'205 CHF	101.75%	1'226'087.50	0.16	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	1'750	0	150	1'600 CHF	99.60%	1'593'600.00	0.21	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	1'400	0	600	800 CHF	99.75%	798'000.00	0.11	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	3'000	0	840	2'160 CHF	100.40%	2'168'640.00	0.29	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	1'450	0	0	1'450 CHF	101.50%	1'471'750.00	0.19	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	1'900	0	695	1'205 CHF	100.00%	1'205'000.00	0.16	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	1'050	0	360	690 CHF	99.20%	684'480.00	0.09	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	1'550	0	550	1'000 CHF	100.85%	1'008'500.00	0.13	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	1'500	0	455	1'045 CHF	100.90%	1'054'405.00	0.14	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	1'500	0	485	1'015 CHF	100.60%	1'021'090.00	0.14	a)
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	850	0	360	490 CHF	101.30%	496'370.00	0.07	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	1'700	0	300	1'400 CHF	100.10%	1'401'400.00	0.19	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	1'050	0	0	1'050 CHF	100.65%	1'056'825.00	0.14	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	1'800	0	400	1'400 CHF	101.45%	1'420'300.00	0.19	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	2'250	0	500	1'750 CHF	100.60%	1'760'500.00	0.23	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.
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	1'800	150	475	1'475 CHF	102.05%	1'505'237.50	0.20	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'500	0	165	1'335 CHF	99.87%	1'333'264.50	0.18	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	1'450	150	420	1'180 CHF	102.35%	1'207'730.00	0.16	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	1'450	0	405	1'045 CHF	102.50%	1'071'125.00	0.14	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	1'750	0	545	1'205 CHF	99.85%	1'203'192.50	0.16	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	1'800	0	400	1'400 CHF	106.10%	1'485'400.00	0.20	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	3'400	0	1'135	2'265 CHF	102.10%	2'312'565.00	0.31	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'200	0	675	1'525 CHF	99.87%	1'523'017.50	0.20	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'230	0	705	1'525 CHF	101.15%	1'542'537.50	0.20	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	880	0	0	880 CHF	100.65%	885'720.00	0.12	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	1'700	0	335	1'365 CHF	100.30%	1'369'095.00	0.18	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	2'550	200	700	2'050 CHF	107.00%	2'193'500.00	0.29	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	2'575	0	250	2'325 CHF	102.10%	2'373'825.00	0.31	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	1'950	0	200	1'750 CHF	102.50%	1'793'750.00	0.24	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	800	0	200	600 CHF	101.50%	609'000.00	0.08	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	800	0	230	570 CHF	105.00%	598'500.00	0.08	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	1'300	120	255	1'165 CHF	101.10%	1'177'815.00	0.16	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	1'400	250	560	1'090 CHF	103.85%	1'131'965.00	0.15	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	1'200	200	400	1'000 CHF	104.50%	1'045'000.00	0.14	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'300	0	250	1'050 CHF	104.95%	1'101'975.00	0.15	a)
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	1'100	0	300	800 CHF	103.70%	829'600.00	0.11	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	1'000	0	200	800 CHF	101.87%	814'960.00	0.11	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'400	0	475	925 CHF	101.13%	935'452.50	0.12	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	1'200	0	405	795 CHF	104.15%	827'992.50	0.11	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	850	0	285	565 CHF	102.35%	578'277.50	0.08	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	800	0	300	500 CHF	103.05%	515'250.00	0.07	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	950	0	350	600 CHF	107.65%	645'900.00	0.09	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	2'450	0	730	1'720 CHF	102.90%	1'769'880.00	0.23	a)
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	1'600	0	680	920 CHF	100.84%	927'728.00	0.12	a)
CH1227937708	2.5025 % EOANGR 2.5025 12/05/29 EMTN	900	0	100	800 CHF	106.30%	850'400.00	0.11	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	3'000	0	800	2'200 CHF	103.45%	2'275'900.00	0.30	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	1'550	300	400	1'450 CHF	101.50%	1'471'750.00	0.19	a)
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	2'000	350	705	1'645 CHF	104.30%	1'715'735.00	0.23	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	3'500	0	1'200	2'300 CHF	101.50%	2'334'500.00	0.31	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'250	0	920	1'330 CHF	100.60%	1'337'980.00	0.18	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	1'600	0	300	1'300 CHF	101.59%	1'320'670.00	0.17	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	1'800	0	500	1'300 CHF	105.40%	1'370'200.00	0.18	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	1'650	0	725	925 CHF	117.65%	1'088'262.50	0.14	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	2'100	0	685	1'415 CHF	101.40%	1'434'810.00	0.19	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	1'700	0	480	1'220 CHF	103.80%	1'266'360.00	0.17	a)
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	1'050	0	250	800 CHF	105.25%	842'000.00	0.11	a)
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	800	0	200	600 CHF	103.55%	621'300.00	0.08	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEL 2.1375 12/13/27 EMTN	950	0	200	750 CHF	102.50%	768'750.00	0.10	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	103.05%	824'400.00	0.11	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	1'800	0	400	1'400 CHF	104.75%	1'466'500.00	0.19	a)
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	1'300	200	400	1'100 CHF	104.60%	1'150'600.00	0.15	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	1'100	0	150	950 CHF	102.00%	969'000.00	0.13	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	2'950	0	1'005	1'945 CHF	101.02%	1'964'839.00	0.26	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	1'300	0	140	1'160 CHF	105.20%	1'220'320.00	0.16	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	1'400	400	600	1'200 CHF	103.20%	1'238'400.00	0.16	a)
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	1'000	0	300	700 CHF	104.00%	728'000.00	0.10	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	870	0	220	650 CHF	105.10%	683'150.00	0.09	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	2'200	0	1'155	1'045 CHF	100.66%	1'051'897.00	0.14	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	2'800	0	755	2'045 CHF	102.50%	2'096'125.00	0.28	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	2'150	0	760	1'390 CHF	102.65%	1'426'835.00	0.19	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	1'450	0	625	825 CHF	101.10%	834'075.00	0.11	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	1'400	0	200	1'200 CHF	101.75%	1'221'000.00	0.16	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.
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	2'150	0	975	1'175 CHF	104.10%	1'223'175.00	0.16	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	2'300	0	700	1'600 CHF	105.25%	1'684'000.00	0.22	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	1'800	0	665	1'135 CHF	102.90%	1'167'915.00	0.15	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	1'300	0	200	1'100 CHF	100.97%	1'110'670.00	0.15	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	850	0	300	550 CHF	102.55%	564'025.00	0.07	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	1'650	0	250	1'400 CHF	104.33%	1'460'620.00	0.19	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	2'200	0	600	1'600 CHF	105.55%	1'688'800.00	0.22	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	2'000	0	600	1'400 CHF	105.65%	1'479'100.00	0.20	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.85%	1'439'900.00	0.19	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	1'400	0	400	1'000 CHF	101.95%	1'019'500.00	0.13	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	2'150	0	705	1'445 CHF	105.30%	1'521'585.00	0.20	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	1'300	0	415	885 CHF	102.65%	908'452.50	0.12	a)
CH1244731753	2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTM	1'000	0	200	800 CHF	104.60%	836'800.00	0.11	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	650	0	0	650 CHF	101.38%	658'970.00	0.09	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	1'500	0	300	1'200 CHF	103.70%	1'244'400.00	0.16	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	1'550	150	500	1'200 CHF	101.48%	1'217'760.00	0.16	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	2'250	150	655	1'745 CHF	106.00%	1'849'700.00	0.24	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'200	0	250	950 CHF	104.60%	993'700.00	0.13	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	800	0	200	600 CHF	104.35%	626'100.00	0.08	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	600	0	0	600 CHF	106.55%	639'300.00	0.08	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	103.90%	831'200.00	0.11	a)
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	2'650	0	925	1'725 CHF	107.90%	1'861'275.00	0.25	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	3'000	0	800	2'200 CHF	103.90%	2'285'800.00	0.30	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	3'120	200	855	2'465 CHF	103.00%	2'538'950.00	0.34	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	1'950	0	580	1'370 CHF	105.15%	1'440'555.00	0.19	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	2'450	0	190	2'260 CHF	103.85%	2'347'010.00	0.31	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	1'900	0	655	1'245 CHF	105.00%	1'307'250.00	0.17	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	1'600	0	450	1'150 CHF	103.35%	1'188'525.00	0.16	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	2'400	0	1'190	1'210 CHF	103.35%	1'250'535.00	0.17	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	2'700	0	750	1'950 CHF	103.50%	2'018'250.00	0.27	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	3'050	0	640	2'410 CHF	103.75%	2'500'375.00	0.33	a)
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	800	0	200	600 CHF	105.10%	630'600.00	0.08	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	3'900	0	1'590	2'310 CHF	101.60%	2'346'960.00	0.31	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	1'950	0	570	1'380 CHF	105.65%	1'457'970.00	0.19	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	1'700	0	400	1'300 CHF	102.50%	1'332'500.00	0.18	a)
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	1'100	0	300	800 CHF	107.20%	857'600.00	0.11	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	1'750	0	250	1'500 CHF	106.35%	1'595'250.00	0.21	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	4'345	250	1'290	3'305 CHF	102.85%	3'399'192.50	0.45	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	3'350	0	650	2'700 CHF	108.50%	2'929'500.00	0.39	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	1'400	0	550	850 CHF	105.45%	896'325.00	0.12	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	2'600	0	880	1'720 CHF	104.45%	1'796'540.00	0.24	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	2'600	0	800	1'800 CHF	104.45%	1'880'100.00	0.25	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	1'200	0	635	565 CHF	101.35%	572'627.50	0.08	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	2'400	150	680	1'870 CHF	102.95%	1'925'165.00	0.25	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	2'000	0	550	1'450 CHF	102.10%	1'480'450.00	0.20	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	2'100	0	700	1'400 CHF	106.20%	1'486'800.00	0.20	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	1'000	0	300	700 CHF	106.85%	747'950.00	0.10	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	2'200	0	600	1'600 CHF	105.45%	1'687'200.00	0.22	a)
CH1271007952	2.3750 % HYNOC 2 3/8 01/26/29 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	103.00%	824'000.00	0.11	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	2'500	0	715	1'785 CHF	105.50%	1'883'175.00	0.25	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	1'400	0	400	1'000 CHF	105.00%	1'050'000.00	0.14	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	1'300	0	410	890 CHF	107.70%	958'530.00	0.13	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	900	600	335	1'165 CHF	102.45%	1'193'542.50	0.16	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	1'700	0	530	1'170 CHF	104.15%	1'218'555.00	0.16	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.
CH1271360575	1.7500 % AIB 1 3/4 06/26/30	1'750	0	250	1'500 CHF	104.70%	1'570'500.00	0.21	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	1'810	0	350	550 CHF	104.90%	576'950.00	0.08	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	2'000	0	1'000	1'000 CHF	105.60%	1'056'000.00	0.14	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWKB 1.6275 07/27/28 EMTN	850	0	200	650 CHF	103.40%	672'100.00	0.09	a)
CH1271360617	1.2125 % EBRD 1.2125 03/04/31 EMTN	1'800	0	485	1'315 CHF	102.65%	1'349'847.50	0.18	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	2'605	0	755	1'850 CHF	105.15%	1'945'275.00	0.26	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	955	0	0	955 CHF	101.12%	965'696.00	0.13	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	1'900	0	585	1'315 CHF	101.13%	1'329'859.50	0.18	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	1'200	0	400	800 CHF	102.45%	819'600.00	0.11	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	2'700	0	850	1'850 CHF	105.30%	1'948'050.00	0.26	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	850	0	280	570 CHF	103.95%	592'515.00	0.08	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	2'200	0	800	1'400 CHF	104.60%	1'464'400.00	0.19	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	2'050	0	530	1'520 CHF	107.40%	1'632'480.00	0.22	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSFC 2.7325 07/04/25 EMTN	1'460	0	1'460	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269763	2.9325 % SANSFC 2.9325 07/04/28 EMTN	1'700	0	865	835 CHF	105.35%	879'672.50	0.12	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	825	0	100	725 CHF	103.20%	748'200.00	0.10	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'300	0	610	1'690 CHF	106.70%	1'803'230.00	0.24	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	2'500	200	850	1'850 CHF	107.90%	1'996'150.00	0.26	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	1'600	0	400	1'200 CHF	104.15%	1'249'800.00	0.17	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	1'300	0	400	900 CHF	107.05%	963'450.00	0.13	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	1'700	0	500	1'200 CHF	102.35%	1'228'200.00	0.16	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	1'800	0	585	1'305 CHF	106.30%	1'387'215.00	0.18	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	2'650	0	700	1'950 CHF	103.40%	2'016'300.00	0.27	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	900	0	300	600 CHF	108.85%	653'100.00	0.09	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	1'500	0	190	1'310 CHF	104.60%	1'370'260.00	0.18	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	1'845	0	200	1'645 CHF	102.20%	1'681'190.00	0.22	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	3'900	0	1'155	2'745 CHF	102.55%	2'814'997.50	0.37	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	1'600	0	400	1'200 CHF	102.80%	1'233'600.00	0.16	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	106.25%	850'000.00	0.11	a)
CH1289657095	1.8750 % VORHYP 1 7/8 09/13/30 EMTN	1'200	0	150	1'050 CHF	104.60%	1'098'300.00	0.15	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	1'900	0	555	1'345 CHF	105.05%	1'412'922.50	0.19	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	2'600	0	700	1'900 CHF	101.95%	1'937'050.00	0.26	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	1'600	0	525	1'075 CHF	104.55%	1'123'912.50	0.15	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	1'800	0	400	1'400 CHF	103.50%	1'449'000.00	0.19	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	1'400	0	515	885 CHF	100.85%	892'522.50	0.12	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	905	95	115	885 CHF	104.70%	926'595.00	0.12	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	3'500	300	1'300	2'500 CHF	103.05%	2'576'250.00	0.34	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	3'200	0	1'245	1'955 CHF	105.25%	2'057'637.50	0.27	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 EMTN	1'400	400	800	1'000 CHF	103.50%	1'035'000.00	0.14	a)
CH1290871032	1.3475 % TPNZ 1.3475 03/21/31 EMTN	0	1'175	290	885 CHF	102.25%	904'912.50	0.12	a)
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	2'500	770	1'730 CHF	103.40%	1'788'820.00	0.24	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	1'400	0	495	905 CHF	103.50%	936'675.00	0.12	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	1'700	0	490	1'210 CHF	102.65%	1'242'065.00	0.16	a)
CH1291809916	2.5500 % EDF 2.55 09/12/31 EMTN	1'000	0	270	730 CHF	105.60%	770'880.00	0.10	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	2'160	0	565	1'595 CHF	102.00%	1'626'900.00	0.22	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	1'100	0	370	730 CHF	104.70%	764'310.00	0.10	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	1'000	0	275	725 CHF	103.20%	748'200.00	0.10	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	1'400	0	0	1'400 CHF	103.45%	1'448'300.00	0.19	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	1'700	0	315	1'385 CHF	103.25%	1'430'012.50	0.19	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	1'300	0	400	900 CHF	103.95%	935'550.00	0.12	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	1'400	150	390	1'160 CHF	104.35%	1'210'460.00	0.16	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	900	0	300	600 CHF	103.75%	622'500.00	0.08	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	1'200	0	340	860 CHF	101.65%	874'190.00	0.12	a)
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	1'100	0	450	650 CHF	104.70%	680'550.00	0.09	a)
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	800	0	200	600 CHF	102.55%	615'300.00	0.08	a)
CH1296276160	2.7475 % ACHMEA 2.7475 10/16/30 EMTN	900	0	300	600 CHF	107.00%	642'000.00	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.
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	2'390	0	700	1'690 CHF	105.70%	1'786'330.00	0.24	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	1'800	150	505	1'445 CHF	106.20%	1'534'590.00	0.20	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	2'100	0	200	1'900 CHF	101.80%	1'934'200.00	0.26	a)
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	1'700	0	390	1'310 CHF	104.50%	1'368'950.00	0.18	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	900	0	250	650 CHF	103.00%	669'500.00	0.09	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	1'800	0	585	1'215 CHF	103.70%	1'259'955.00	0.17	a)
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	1'000	0	700	300 CHF	105.05%	315'150.00	0.04	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	2'650	0	800	1'850 CHF	101.90%	1'885'150.00	0.25	a)
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	1'300	0	465	835 CHF	104.60%	873'410.00	0.12	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	2'400	0	1'005	1'395 CHF	101.95%	1'422'202.50	0.19	a)
CH1305916749	1.5600 % AUCCCN 1.56 11/30/29 EMTN	1'000	0	325	675 CHF	103.25%	696'937.50	0.09	a)
CH1305916889	2.2150 % GLENLN 2.215 01/18/30 EMTN	1'350	0	0	1'350 CHF	102.55%	1'384'425.00	0.18	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	1'700	0	685	1'015 CHF	102.70%	1'042'405.00	0.14	a)
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	2'100	0	915	1'185 CHF	101.90%	1'207'515.00	0.16	a)
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	850	0	200	650 CHF	102.35%	665'275.00	0.09	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	2'000	0	795	1'205 CHF	101.60%	1'224'280.00	0.16	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	1'300	0	410	890 CHF	103.70%	922'930.00	0.12	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	2'900	0	950	1'950 CHF	104.80%	2'043'600.00	0.27	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	2'400	0	775	1'625 CHF	102.05%	1'658'312.50	0.22	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	1'500	0	500	1'000 CHF	102.95%	1'029'500.00	0.14	a)
CH1321481538	2.5000 % MUNHYP 2 1/2 02/20/30 EMTN	1'400	0	600	800 CHF	104.45%	835'600.00	0.11	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	1'400	0	500	900 CHF	103.90%	935'100.00	0.12	a)
CH1321508330	1.5000 % CDCEPS 1 1/2 05/24/39 EMTN	0	1'200	400	800 CHF	104.90%	839'200.00	0.11	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	1'600	550	1'050 CHF	102.80%	1'079'400.00	0.14	a)
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	3'485	685	2'800 CHF	102.60%	2'872'800.00	0.38	a)
CH1321508363	1.5650 % EDF 1.565 09/06/29 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	99.94%	1'099'285.00	0.15	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	1'400	0	410	990 CHF	103.60%	1'025'640.00	0.14	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	2'275	0	0	2'275 CHF	101.75%	2'314'812.50	0.31	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	2'620	0	250	2'370 CHF	104.30%	2'471'910.00	0.33	a)
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	1'300	0	700	600 CHF	101.55%	609'300.00	0.08	a)
CH1325807845	2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30	1'300	0	700	600 CHF	102.25%	613'500.00	0.08	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	2'900	0	915	1'985 CHF	102.00%	2'024'700.00	0.27	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	2'600	0	800	1'800 CHF	103.30%	1'859'400.00	0.25	a)
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	2'400	150	955	1'595 CHF	105.20%	1'677'940.00	0.22	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	2'200	150	170	2'180 CHF	101.70%	2'217'060.00	0.29	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	2'900	0	390	2'510 CHF	103.65%	2'601'615.00	0.34	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	2'200	250	240	2'210 CHF	106.05%	2'343'705.00	0.31	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	2'400	700	1'700 CHF	102.85%	1'748'450.00	0.23	a)
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	2'200	640	1'560 CHF	103.15%	1'609'140.00	0.21	a)
CH1331113576	2.0105 % SWEDA 2.0105 10/10/30	0	1'200	400	800 CHF	103.05%	824'400.00	0.11	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	2'300	675	1'625 CHF	101.00%	1'641'250.00	0.22	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	1'600	555	1'045 CHF	102.20%	1'067'990.00	0.14	a)
CH1331113626	1.3150 % SCDA 1.315 05/02/34	0	900	0	900 CHF	102.90%	926'100.00	0.12	a)
CH1335850256	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 APR	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850264	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 APR	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	1'100	395	705 CHF	102.05%	719'452.50	0.10	a)
CH1335850280	1.1525 % NIB 1.1525 05/02/31 EMTN	0	1'000	365	635 CHF	102.50%	650'875.00	0.09	a)
CH1335850298	1.4778 % AFLBNK 1.4778 04/20/34 EMTN	0	1'000	400	600 CHF	102.80%	616'800.00	0.08	a)
CH1335850306	2.8000 % UINT 2.8 07/23/27	0	900	0	900 CHF	101.10%	909'900.00	0.12	a)
CH1335850314	0.9475 % IADB 0.9475 07/26/32	0	1'000	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.13	a)
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.94%	199'880.00	0.03	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	2'000	740	1'260 CHF	101.95%	1'284'570.00	0.17	a)
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	1'200	505	695 CHF	101.60%	706'120.00	0.09	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	3'400	775	2'625 CHF	104.35%	2'739'187.50	0.36	a)
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	95	95	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	0	2'600	500	2'100 CHF	103.15%	2'166'150.00	0.29	a)
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28 4Y	0	2'800	150	2'650 CHF	101.40%	2'687'100.00	0.36	a)
CH1344316703	1.9150 % SLOVAK 1.915 05/10/34 10Y	0	2'600	0	2'600 CHF	103.65%	2'694'900.00	0.36	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.
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	1'200	300	900 CHF	101.90%	917'100.00	0.12	a)
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	1'200	300	900 CHF	104.25%	938'250.00	0.12	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	2'000	600	1'400 CHF	101.80%	1'425'200.00	0.19	a)
CH1348614160	2.0975 % AGUAND 2.0975 05/30/29	0	800	200	600 CHF	101.50%	609'000.00	0.08	a)
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	1'000	250	750 CHF	102.55%	769'125.00	0.10	a)
CH1353257749	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 EMTN	0	1'400	250	1'150 CHF	105.50%	1'213'250.00	0.16	a)
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	2'100	415	1'685 CHF	103.75%	1'748'187.50	0.23	a)
CH1353257905	2.0000 % BNS 2 08/02/30 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	103.90%	1'662'400.00	0.22	a)
CH1353258168	1.1575 % IBRD 1.1575 06/11/31 EMTN	0	2'175	370	1'805 CHF	102.70%	1'853'735.00	0.25	a)
CH1356197108	2.1500 % TRAGR 2.15 06/18/27 EMTN	0	1'900	250	1'650 CHF	101.55%	1'675'575.00	0.22	a)
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	0	1'554	200	1'354 CHF	103.35%	1'398'952.83	0.18	a)
CH1356570312	1.7425 % EDF 1.7425 09/06/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.64%	996'390.00	0.13	a)
CH1356570320	1.9875 % CMZB 1.9875 09/09/31	0	1'400	0	1'400 CHF	99.79%	1'396'990.00	0.18	a)
CH1357852677	1.3800 % IBESM 1.38 07/11/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.13	a)
CH1357852685	1.5625 % IBESM 1.5625 07/11/31 EMTN	0	1'135	0	1'135 CHF	101.05%	1'146'917.50	0.15	a)
CH1357852735	1.4900 % HANWHA 1.49 08/06/27	0	905	0	905 CHF	100.75%	911'787.50	0.12	a)
CH1357852750	1.5100 % BHH 1.51 07/31/30 EMTN	0	900	0	900 CHF	100.70%	906'300.00	0.12	a)
CH1357852792	0.9600 % TCV 0.96 09/04/34 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.21%	1'002'090.00	0.13	a)
CH1357852800	2.0000 % ANNGR 2 08/26/31 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.75%	1'511'250.00	0.20	a)
CH1357852818	1.4450 % NWG 1.445 08/27/29 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	100.15%	1'201'800.00	0.16	a)
CH1357852826	1.3075 % NONGNO 1.3075 08/28/30 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	99.90%	1'098'900.00	0.15	a)
CH1359203382	2.3450 % SANTAN 2.345 07/03/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.55%	2'071'000.00	0.27	a)
CH1360612472	0.9925 % CDCEPS 0.9925 09/23/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.88%	998'840.00	0.13	a)
CH1371736781	1.2925 % DNBNO 1.2925 03/05/31 EMTN	0	800	0	800 CHF	99.97%	799'760.00	0.11	a)
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	1'600	0	1'600 CHF	99.83%	1'597'200.00	0.21	a)
CH1377443812	2.1275 % ECLCI 2.1275 09/26/29	0	1'400	0	1'400 CHF	99.96%	1'399'426.00	0.19	a)
CHF							749'436'619.83	99.09	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'000'746.11	0.26
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	749'436'619.83	99.09
Sonstige Vermögenswerte	4'850'735.72	0.64
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	756'288'101.66	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-1'578.08	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	756'286'523.58	

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);	749'436'619.83	99.09
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	Kurswert CHF	in % 7)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	142'125'311.00	18.79
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	3'630 CHF 101.60% 3'688'080.00 0.49
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	500 CHF 116.05% 580'250.00 0.08
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	1'000 CHF 125.75% 1'257'500.00 0.17
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'100 CHF 126.40% 1'390'400.00 0.18
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	2'500 CHF 113.80% 2'845'000.00 0.38
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'000 CHF 122.35% 1'223'500.00 0.16
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	500 CHF 105.15% 525'750.00 0.07
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	500 CHF 103.35% 516'750.00 0.07
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	1'805 CHF 101.35% 1'829'367.50 0.24

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	1'100 CHF	100.05%	1'100'550.00	0.15	
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	500 CHF	98.65%	493'250.00	0.07	
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	2'890 CHF	99.60%	2'878'440.00	0.38	
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	105 CHF	100.82%	105'861.00	0.01	
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	800 CHF	98.40%	787'200.00	0.10	
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	970 CHF	98.75%	957'875.00	0.13	
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	2'400 CHF	98.55%	2'365'200.00	0.31	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	500 CHF	94.40%	472'000.00	0.06	
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	1'525 CHF	98.91%	1'508'377.50	0.20	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	500 CHF	96.50%	482'500.00	0.06	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	500 CHF	96.80%	484'000.00	0.06	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	500 CHF	99.60%	498'000.00	0.07	
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	500 CHF	92.35%	461'750.00	0.06	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	825 CHF	97.85%	807'262.50	0.11	
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	500 CHF	95.25%	476'250.00	0.06	
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	0.13	
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	500 CHF	99.05%	495'250.00	0.07	
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	1'000 CHF	87.80%	878'000.00	0.12	
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	1'480 CHF	98.85%	1'462'980.00	0.19	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	1'845 CHF	99.50%	1'835'775.00	0.24	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	500 CHF	98.40%	492'000.00	0.07	
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	2'340 CHF	95.95%	2'245'230.00	0.30	
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	1'645 CHF	94.50%	1'554'525.00	0.21	
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	1'200 CHF	96.00%	1'152'000.00	0.15	
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	1'625 CHF	98.94%	1'607'775.00	0.21	
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	500 CHF	95.95%	479'750.00	0.06	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	500 CHF	93.55%	467'750.00	0.06	
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	550 CHF	97.75%	537'625.00	0.07	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	500 CHF	98.73%	493'650.00	0.07	
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	1'150 CHF	97.00%	1'115'500.00	0.15	
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	500 CHF	98.25%	491'250.00	0.06	
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	600 CHF	98.15%	588'900.00	0.08	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	1'500 CHF	94.65%	1'419'750.00	0.19	
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	500 CHF	95.60%	478'000.00	0.06	
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	1'600 CHF	98.64%	1'578'240.00	0.21	
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	1'000 CHF	94.70%	947'000.00	0.13	
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	800 CHF	95.50%	764'000.00	0.10	
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	1'000 CHF	98.05%	980'500.00	0.13	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	1'100 CHF	92.55%	1'018'050.00	0.13	
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	2'000 CHF	97.55%	1'951'000.00	0.26	
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	850 CHF	94.50%	803'250.00	0.11	
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	1'620 CHF	94.90%	1'537'380.00	0.20	
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	1'000 CHF	97.30%	973'000.00	0.13	
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'520 CHF	97.25%	1'478'200.00	0.20	
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	1'200 CHF	94.85%	1'138'200.00	0.15	
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'170 CHF	83.50%	976'950.00	0.13	
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	500 CHF	95.20%	476'000.00	0.06	
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	2'300 CHF	96.95%	2'229'850.00	0.29	
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'350 CHF	96.75%	1'306'125.00	0.17	
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	1'080 CHF	95.20%	1'028'160.00	0.14	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	500 CHF	96.00%	480'000.00	0.06	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.19	
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	1'500 CHF	96.40%	1'446'000.00	0.19	
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	500 CHF	97.30%	486'500.00	0.06	
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	1'250 CHF	96.25%	1'203'125.00	0.16	
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	1'240 CHF	93.05%	1'153'820.00	0.15	
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	1'000 CHF	90.25%	902'500.00	0.12	
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	915 CHF	94.85%	867'877.50	0.11	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	400 CHF	97.15%	388'600.00	0.05	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	650 CHF	97.15%	631'475.00	0.08	
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'000 CHF	94.35%	943'500.00	0.12	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	1'200 CHF	94.25%	1'131'000.00	0.15	
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'230 CHF	95.95%	1'180'185.00	0.16	
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	500 CHF	94.50%	472'500.00	0.06	
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	1'200 CHF	96.45%	1'157'400.00	0.15	
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	800 CHF	99.70%	797'600.00	0.11	
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'045 CHF	98.55%	1'029'847.50	0.14	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	500 CHF	98.70%	493'500.00	0.07	
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	1'565 CHF	99.40%	1'555'610.00	0.21	
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	900 CHF	100.80%	907'200.00	0.12	
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	500 CHF	99.60%	498'000.00	0.07	
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	2'000 CHF	100.40%	2'008'000.00	0.27	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	1'200 CHF	100.00%	1'200'000.00	0.16	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	690 CHF	99.20%	684'480.00	0.09	
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	490 CHF	101.30%	496'370.00	0.07	
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	1'000 CHF	100.60%	1'006'000.00	0.13	
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	2'265 CHF	102.10%	2'312'565.00	0.31	
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	1'335 CHF	101.15%	1'350'352.50	0.18	
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	500 CHF	100.30%	501'500.00	0.07	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'050 CHF	104.95%	1'101'975.00	0.15	
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	750 CHF	101.87%	764'025.00	0.10	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	750 CHF	100.60%	754'500.00	0.10	
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	1'000 CHF	105.40%	1'054'000.00	0.14	
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	500 CHF	105.25%	526'250.00	0.07	
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	950 CHF	102.00%	969'000.00	0.13	
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	500 CHF	105.20%	526'000.00	0.07	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	2'045 CHF	102.50%	2'096'125.00	0.28	
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	500 CHF	101.10%	505'500.00	0.07	
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	500 CHF	102.65%	513'250.00	0.07	
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	1'050 CHF	101.48%	1'065'540.00	0.14	
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	1'745 CHF	106.00%	1'849'700.00	0.24	
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	950 CHF	104.60%	993'700.00	0.13	
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	2'200 CHF	103.90%	2'285'800.00	0.30	
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'265 CHF	103.00%	2'332'950.00	0.31	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	2'410 CHF	103.75%	2'500'375.00	0.33	
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	600 CHF	105.10%	630'600.00	0.08	
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	500 CHF	107.70%	538'500.00	0.07	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	500 CHF	105.30%	526'500.00	0.07	
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	500 CHF	103.95%	519'750.00	0.07	
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	500 CHF	105.35%	526'750.00	0.07	
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	600 CHF	107.90%	647'400.00	0.09	
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	1'200 CHF	102.35%	1'228'200.00	0.16	
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	1'300 CHF	106.30%	1'381'900.00	0.18	
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	600 CHF	108.85%	653'100.00	0.09	
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	500 CHF	105.05%	525'250.00	0.07	
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	500 CHF	103.20%	516'000.00	0.07	
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	900 CHF	103.95%	935'550.00	0.12	
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	600 CHF	102.55%	615'300.00	0.08	
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	500 CHF	106.20%	531'000.00	0.07	
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	300 CHF	105.05%	315'150.00	0.04	
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	800 CHF	104.60%	836'800.00	0.11	
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	150 CHF	102.35%	153'525.00	0.02	
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	500 CHF	101.60%	508'000.00	0.07	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	1'500 CHF	104.80%	1'572'000.00	0.21	
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	800 CHF	102.95%	823'600.00	0.11	
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	800 CHF	103.90%	831'200.00	0.11	
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	500 CHF	102.60%	513'000.00	0.07	
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	700 CHF	103.60%	725'200.00	0.10	
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	500 CHF	101.75%	508'750.00	0.07	
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	600 CHF	101.55%	609'300.00	0.08	
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	500 CHF	103.65%	518'250.00	0.07	
CH1331113626	1.3150 % SCDA 1.315 05/02/34	500 CHF	102.90%	514'500.00	0.07	
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	500 CHF	102.05%	510'250.00	0.07	
CH1335850314	0.9475 % IADB 0.9475 07/26/32	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.13	
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	2'100 CHF	103.15%	2'166'150.00	0.29	
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	900 CHF	101.90%	917'100.00	0.12	
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	1'000 CHF	101.80%	1'018'000.00	0.13	
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	750 CHF	102.55%	769'125.00	0.10	
CH1353258168	1.1575 % IBRD 1.1575 06/11/31 EMTN	1'805 CHF	102.70%	1'853'735.00	0.25	
CH1357852685	1.5625 % IBESM 1.5625 07/11/31 EMTN	500 CHF	101.05%	505'250.00	0.07	
CH1357852750	1.5100 % BHH 1.51 07/31/30 EMTN	500 CHF	100.70%	503'500.00	0.07	
CH1359203382	2.3450 % SANTAN 2.345 07/03/31 EMTN	400 CHF	103.55%	414'200.00	0.05	

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	30'356'457.85	19.894
Bond	CHF	121'423'007.60	79.573
Equity	CHF	813'743.09	0.533
Total	CHF	152'593'208.54	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	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.269	-	-	-
FA CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.269	-	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.269	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.269	-	-	-

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	142'125'311.00
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
DT CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	3.000
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® Foreign AAA-BBB Index 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.