

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. WORLD EX EUR/USD

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	31562119	CHF
NT CHF	11705245	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	17
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
7	Pauschale Verwaltungskommission	18
8	Benchmark	18
9	TER	18
10	Fussnoten	19
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20

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		72'290'818.42	73'163'897.83	50'711'082.29	73'650'595.21
Klasse FA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		182'269.41	182'827.05	123'166.31	159'730.09
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'469.000	2'469.000	1'633.000	1'633.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		73.8232	74.0490	75.4233	97.8139
Ausschüttung je Anteil		-	2.45	2.55	3.00
Total Expense Ratio (TER)		0.31 %	0.31 %	0.31 %	0.31 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		72'108'549.01	72'981'070.78	50'587'915.98	73'490'865.12
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		693'947.566	716'011.397	499'519.211	573'991.942
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		103.9107	101.9272	101.2732	128.0347
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		122.4712	115.7541	108.0536	139.5549
Thesaurierung je Anteil		-	3.61	3.75	4.35
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	3.06 %	3.06 %	-27.46 %	-1.52 %
Klasse NT CHF	3.21 %	3.36 %	-27.21 %	-1.21 %
Benchmark	3.15 %	3.52 %	-27.64 %	-1.41 %
Tracking Error ³³⁾	-	0.16 %	0.30 %	0.11 %

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	-0.09 %
Klasse NT CHF	0.06 %

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	387'848.58	896'559.75
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	70'707'782.88	71'111'043.00
Sonstige Vermögenswerte	1'195'414.90	1'156'339.67
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	72'291'046.36	73'163'942.42
Andere Verbindlichkeiten	-227.94	-44.59
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	72'290'818.42	73'163'897.83

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von	01.03.2024	01.03.2023
	bis	31.08.2024	29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'469.000	1'633.000
Ausgegebene Anteile		-	836.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'469.000	2'469.000

Klasse NT CHF	von	01.03.2024	01.03.2023
	bis	31.08.2024	29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		716'011.397	499'519.211
Ausgegebene Anteile		30'811.878	237'000.497
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	6'321.840
Zurückgenommene Anteile		-52'875.709	-26'830.151
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		693'947.566	716'011.397

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von	01.03.2024	01.03.2023
	bis	31.08.2024	29.02.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		73'163'897.83	50'711'082.29
Ausbezahlte Ausschüttung		-6'049.05	-5'913.45
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-861'639.91	-832'239.04
Saldo aus dem Anteilverkehr		-2'274'054.90	21'436'974.93
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		2'268'664.45	1'853'993.10
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		72'290'818.42	73'163'897.83

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von	01.03.2024	01.03.2023
	bis	31.08.2024	29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		5'415.90	9'427.47
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-553.80	-2'659.77
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'340'834.67	2'362'987.86
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		38'820.89	305'772.98
Total Ertrag		1'384'517.66	2'675'528.54
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-288.58	-530.39
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-26'467.90	-80'492.87
Total Aufwand		-26'756.48	-81'023.26
Nettoertrag / Verlust		1'357'761.18	2'594'505.28
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'720'629.09	-1'494'698.83
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		19'264.65	136'538.11
Realisierter Erfolg		-343'603.26	1'236'344.56
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'612'267.71	617'648.54
Gesamterfolg		2'268'664.45	1'853'993.10

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							70'707'782.88	97.81	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							70'707'782.88	97.81	
BE0002820018	1.2500 % KBCBB 1 1/4 09/21/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.63%	103'283.86	0.14	a)
BE0390118819	6.1510 % KBCBB 6.151 03/19/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.50%	113'180.15	0.16	a)
BE0934986036	9.7500 % ABIBB 9 3/4 07/30/24 EMTN	75	0	75	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
BE6258029741	4.0000 % ABIBB 4 09/24/25 EMTN	140	0	0	140 GBP	99.07%	154'652.48	0.21	a)
BE6295393936	2.2500 % ABIBB 2 1/4 05/24/29 EMTN	30	0	0	30 GBP	91.90%	30'741.63	0.04	a)
BE6316405560	1.2500 % EUROCL 1 1/4 09/30/24 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.60%	111'064.86	0.15	a)
CH0330938876	2.7500 % UBS 2 3/4 08/08/25	100	0	0	100 GBP	97.81%	109'062.18	0.15	a)
CH0550413337	2.2500 % UBS 2 1/4 06/09/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.44%	103'082.03	0.14	a)
CH1142754311	2.1250 % UBS 2 1/8 11/15/29	100	0	0	100 GBP	89.02%	99'258.44	0.14	a)
CH1211713180	7.0000 % UBS 7 09/30/27	100	0	0	100 GBP	103.30%	115'185.06	0.16	a)
CH1211713198	7.3750 % UBS 7 3/8 09/07/33	100	0	0	100 GBP	113.16%	126'183.05	0.17	a)
DE000A1G85C2	2.7500 % SIEGR 2 3/4 09/10/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.98%	109'256.20	0.15	a)
DE000A1G85D0	3.7500 % SIEGR 3 3/4 09/10/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	86.10%	96'010.22	0.13	a)
DE000A1HG1L4	4.5000 % ALVGR 4 1/2 03/13/43 62	100	0	0	100 GBP	94.44%	105'306.61	0.15	a)
DE000A3LSV01	5.6250 % TRAGR 5 5/8 01/16/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.48%	112'041.66	0.15	a)
FR0010039008	5.6250 % ORAFP 5 5/8 01/23/34 EMTN	110	0	0	110 GBP	104.98%	128'765.45	0.18	a)
FR0010379255	5.5000 % ENFP 5 1/2 10/06/26	50	0	0	50 GBP	101.51%	56'594.54	0.08	a)
FR0010680041	7.0000 % ENGIFP 7 10/30/28 EMTN	50	0	0	50 GBP	108.10%	60'268.15	0.08	a)
FR0010763177	6.1250 % EDF 6 1/8 06/02/34 EMTN	250	0	250	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0010945436	5.1250 % EDF 5 1/8 09/22/50 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0010946855	5.0000 % ENGIFP 5 10/01/60 EMTN	200	0	0	200 GBP	89.78%	200'225.17	0.28	a)
FR0011132356	5.5000 % EDF 5 1/2 10/17/41 EMTN	300	0	300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0011225150	5.5000 % EDF 5 1/2 03/27/37 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0011710284	6.0000 % EDF 6 01/23/2114 EMTN	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0011855287	5.2500 % BPCEGP 5 1/4 04/16/29	100	0	0	100 GBP	98.65%	110'006.65	0.15	a)
FR0013396538	3.2500 % ORAFP 3 1/4 01/15/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.37%	100'772.71	0.14	a)
FR0013409174	2.7500 % DGFP 2 3/4 09/15/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	84.39%	94'098.98	0.13	a)
FR0013476330	1.8750 % BNP 1 7/8 12/14/27	200	0	0	200 GBP	90.94%	202'814.38	0.28	a)
FR0013480027	1.2500 % BFCM 1 1/4 12/05/25	100	0	0	100 GBP	95.45%	106'429.49	0.15	a)
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.50%	103'144.48	0.14	a)
FR0013487543	1.3750 % BPCEGP 1 3/8 12/23/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.43%	103'063.07	0.14	a)
FR0014001GJ0	1.2500 % BNP 1 1/4 07/13/31 EMTN	200	0	0	200 GBP	78.56%	175'202.88	0.24	a)
FR0014001MX9	0.8750 % BFCM 0 7/8 12/07/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	88.84%	99'065.53	0.14	a)
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.25%	105'095.86	0.15	a)
FR0014005DW1	1.0000 % BFCM 1 07/16/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.28%	104'010.89	0.14	a)
FR0014005E43	2.0000 % BNP 2 09/13/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	72.46%	80'801.71	0.11	a)
FR0014006W73	2.5000 % BPCEGP 2 1/2 11/30/32	100	0	0	100 GBP	89.97%	100'321.10	0.14	a)
FR0014007UQ3	1.8750 % BFCM 1 7/8 10/26/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.41%	99'697.78	0.14	a)
FR0014008NE2	2.8750 % BNP 2 7/8 02/24/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.59%	102'126.41	0.14	a)
FR001400CR01	5.6250 % FRLBP 5 5/8 09/21/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.50%	112'065.08	0.16	a)
FR001400E5E0	4.8750 % BFCM 4 7/8 09/25/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.66%	111'125.07	0.15	a)
FR001400F5X9	5.7500 % BNP 5 3/4 06/13/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.09%	114'949.78	0.16	a)
FR001400F794	5.0000 % BFCM 5 01/19/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.19%	111'719.41	0.15	a)
FR001400FAR2	4.8750 % ACAFP 4 7/8 10/23/29	100	0	0	100 GBP	100.49%	112'055.04	0.16	a)
FR001400FDG9	5.5000 % EDF 5 1/2 01/25/35 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FDH7	5.6250 % EDF 5 5/8 01/25/53 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H1V0	5.6250 % ENGIFP 5 5/8 04/03/53 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.45%	108'658.52	0.15	a)
FR001400I3N2	6.1250 % BPCEGP 6 1/8 05/24/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.25%	115'131.54	0.16	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.97%	115'935.51	0.16	a)
FR001400IKV7	6.3750 % ACAFP 6 3/8 06/14/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.13%	118'337.38	0.16	a)
FR001400ISF3	6.2500 % SOCGEN 6 1/4 06/22/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.90%	119'203.79	0.16	a)
FR001400L461	6.6250 % SUEZFP 6 5/8 10/05/43 EMTN	100	0	0	100 GBP	109.39%	121'981.44	0.17	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.
FR001400M6N9	5.0000 % KERFP 5 11/23/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.13%	110'532.97	0.15	a)
FR001400N5E9	4.8750 % BPCEGP 4 7/8 10/22/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	99.87%	111'362.58	0.15	a)
FR001400N624	5.3750 % ACAFP 5 3/8 01/15/29	100	0	0	100 GBP	100.88%	112'483.23	0.16	a)
FR001400NCB6	5.7500 % SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.21%	111'741.71	0.15	a)
FR001400OFI2	5.0000 % BFCM 5 10/22/29 EMTN	0	100	0	100 GBP	100.95%	112'565.75	0.16	a)
XS0058957316	8.8750 % NWENET 8 7/8 03/25/26 BR	60	0	0	60 GBP	106.03%	70'940.87	0.10	a)
XS0092157600	6.7500 % THAMES 6 3/4 11/16/28 EMTN	40	0	40	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	140	0	0	140 GBP	104.16%	162'604.76	0.22	a)
XS0097777253	6.2500 % SVTLN 6 1/4 06/07/29	150	0	0	150 GBP	103.76%	173'546.99	0.24	a)
XS0113731433	7.6250 % DT 7 5/8 06/15/30	50	0	0	50 GBP	115.00%	64'116.84	0.09	a)
XS0121617517	5.7500 % WMT 5 3/4 12/19/30	60	0	0	60 GBP	107.94%	72'219.42	0.10	a)
XS0132424614	5.8750 % EDF 5 7/8 07/18/31 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0138717441	6.1250 % AVLN 6 1/8 11/14/36	100	0	0	100 GBP	101.32%	112'974.98	0.16	a)
XS0139563166	5.5000 % SSELN 5 1/2 06/07/32	110	0	0	110 GBP	103.81%	127'334.03	0.18	a)
XS0140198044	6.1250 % PRUFIN 6 1/8 12/19/31 EMTN	65	0	0	65 GBP	103.30%	74'868.11	0.10	a)
XS0140516864	5.2500 % GSK 5 1/4 12/19/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	105.62%	117'774.26	0.16	a)
XS0147048762	6.2500 % EOANGR 6 1/4 06/03/30 EMTN	140	0	0	140 GBP	106.45%	166'182.81	0.23	a)
XS0148579666	6.3750 % EOANGR 6 3/8 06/07/32 EMTN	150	0	0	150 GBP	108.07%	180'765.99	0.25	a)
XS0148889420	6.1250 % UKPONE 6 1/8 06/07/27 EMTN	60	0	0	60 GBP	103.41%	69'188.65	0.10	a)
XS0158715713	5.9000 % VOD 5.9 11/26/32 EMTN	250	0	150	100 GBP	106.66%	118'936.17	0.16	a)
XS0159497162	5.7500 % HSBC 5 3/4 12/20/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.52%	113'196.88	0.16	a)
XS0172989252	6.1920 % SWSFIN 6.192 03/31/29 A1	50	0	0	50 GBP	97.53%	54'378.32	0.08	a)
XS0172992637	6.6400 % SWSFIN 6.64 03/31/26 A4	50	0	0	50 GBP	88.56%	49'374.42	0.07	a)
XS0202077953	5.2500 % WMT 5 1/4 09/28/35	120	0	0	120 GBP	105.52%	141'188.62	0.20	a)
XS0241945582	5.3750 % TELEFO 5 3/8 02/02/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.70%	112'286.98	0.16	a)
XS0244171236	4.6250 % SSELN 4 5/8 02/20/37	70	0	0	70 GBP	94.07%	73'422.70	0.10	a)
XS0250116273	4.6740 % ASPR 4.674 03/31/40 B	130	0	0	130 GBP	96.69%	109'243.65	0.15	a)
XS0261559594	4.6250 % WELLTR 4 5/8 07/25/36	180	0	0	180 GBP	100.14%	200'996.58	0.28	a)
XS0268693743	5.1250 % THAMES 5 1/8 09/28/37 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0273815026	4.6250 % WFC 4 5/8 11/02/35	190	0	0	190 GBP	96.91%	205'315.60	0.28	a)
XS0276103156	5.6250 % CKHH 5 5/8 11/24/26 B	100	0	0	100 GBP	101.89%	113'618.38	0.16	a)
XS0276684700	4.8750 % WFC 4 7/8 11/29/35 EMTN	50	0	0	50 GBP	93.49%	52'125.87	0.07	a)
XS0276809927	4.7500 % EJRAIL 4 3/4 12/08/31 EMTN	50	0	0	50 GBP	100.01%	55'760.46	0.08	a)
XS0279211832	4.8750 % WMT 4 7/8 01/19/39	100	0	0	100 GBP	101.68%	113'379.75	0.16	a)
XS0291949120	5.5000 % T 5 1/2 03/15/27	50	0	0	50 GBP	101.14%	56'388.81	0.08	a)
XS0294624373	5.2500 % GSK 5 1/4 04/10/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.24%	114'001.96	0.16	a)
XS0301197546	5.1250 % UPS 5 1/8 02/12/50	50	0	0	50 GBP	101.03%	56'325.25	0.08	a)
XS0306647792	5.7500 % ENELIM 5 3/4 06/22/37 EMTN	140	0	0	140 GBP	102.93%	160'690.84	0.22	a)
XS0306772699	6.3750 % BRITEL 6 3/8 06/23/37 EMTN	100	0	0	100 GBP	107.77%	120'169.45	0.17	a)
XS0327443627	5.8750 % EOANGR 5 7/8 10/30/37 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.26%	116'254.42	0.16	a)
XS0329524457	5.5000 % JNJ 5 1/2 11/06/24	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0330497149	5.7500 % AZN 5 3/4 11/13/31 EMTN	60	0	0	60 GBP	108.88%	72'844.98	0.10	a)
XS0340470490	6.8750 % GS 6 7/8 01/18/38	50	0	0	50 GBP	109.82%	61'229.35	0.08	a)
XS0340495216	5.8750 % GE 5 7/8 01/18/33 EMTN	140	0	0	140 GBP	103.90%	162'203.55	0.22	a)
XS0350820931	6.3750 % GSK 6 3/8 03/09/39 EMTN	100	0	0	100 GBP	114.27%	127'414.09	0.18	a)
XS0356452929	7.0000 % HSBC 7 04/07/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	108.89%	121'414.99	0.17	a)
XS0357124618	7.2500 % GS 7 1/4 04/10/28 GMTN	100	0	0	100 GBP	107.74%	120'132.65	0.17	a)
XS0364880186	6.8750 % AVLN 6 7/8 05/20/58 EMTN	80	0	0	80 GBP	103.77%	92'571.78	0.13	a)
XS0367001061	6.2500 % EDF 6 1/4 05/30/28 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0372391945	6.8000 % C 6.8 06/25/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	115.76%	129'084.47	0.18	a)
XS0379947236	7.0000 % BAC 7 07/31/28 EMTN	250	0	0	250 GBP	107.67%	300'150.42	0.42	a)
XS0383001053	6.4500 % HTHROW 6.45 12/10/31 REGS	100	0	0	100 GBP	107.38%	119'731.22	0.17	a)
XS0383187720	6.2500 % SSELN 6 1/4 08/27/38 EMTN	50	0	0	50 GBP	108.49%	60'486.15	0.08	a)
XS0387079907	6.7500 % HSBC 6 3/4 09/11/28	100	0	0	100 GBP	104.47%	116'489.70	0.16	a)
XS0388006123	7.0000 % CNALN 7 09/19/33 EMTN	140	0	0	140 GBP	112.44%	175'532.27	0.24	a)
XS0398990944	7.2500 % CLARHG 7 1/4 11/12/38	0	50	0	50 GBP	119.59%	66'674.82	0.09	a)
XS0399111912	8.3750 % SSELN 8 3/8 11/20/28 EMTN	90	0	0	90 GBP	113.18%	113'579.80	0.16	a)
XS0399412443	8.1250 % ORAFP 8 1/8 11/20/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	112.70%	125'669.00	0.17	a)
XS0408958683	6.7500 % EOANGR 6 3/4 01/27/39 EMTN	100	0	0	100 GBP	111.94%	124'826.00	0.17	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.
X50416848793	6.8750 % EQNR 6 7/8 03/11/31 EMTN	120	0	0	120 GBP	112.71%	150'821.53	0.21	a)
X50419834931	5.6250 % WMT 5 5/8 03/27/34	250	0	0	250 GBP	108.33%	301'998.66	0.42	a)
X50422688019	6.8750 % VATFAL 6 7/8 04/15/39 EMTN	150	0	0	150 GBP	115.58%	193'315.61	0.27	a)
X50426513387	7.0000 % T 7 04/30/40 EMTN	200	0	0	200 GBP	114.05%	254'348.70	0.35	a)
X50437306904	6.1250 % EOANGR 6 1/8 07/06/39 EMTN	200	0	0	200 GBP	105.99%	236'366.99	0.33	a)
X50439818039	6.3750 % KEL 6 3/8 08/19/39	100	0	0	100 GBP	98.12%	109'413.43	0.15	a)
X50449155455	7.3750 % C 7 3/8 09/01/39 EMTN	160	0	0	160 GBP	121.31%	216'429.89	0.30	a)
X50451790280	5.7500 % KPN 5 3/4 09/17/29 GMTN	130	0	0	130 GBP	103.60%	150'175.46	0.21	a)
X50452187320	5.7500 % ENELIM 5 3/4 09/14/40 EMTN	200	0	0	200 GBP	101.54%	226'442.82	0.31	a)
X50466148441	6.2500 % UKPONE 6 1/4 11/12/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	109.76%	122'389.56	0.17	a)
X50466149506	6.3750 % UKPONE 6 3/8 11/12/31 EMTN	50	0	0	50 GBP	109.21%	60'890.92	0.08	a)
X50468426266	6.0000 % BATSLN 6 11/24/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.88%	114'716.73	0.16	a)
X50471436088	6.7500 % HTHROW 6 3/4 12/03/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.63%	115'559.73	0.16	a)
X50473964509	6.6250 % AEGON 6 5/8 12/16/39 EMTN	50	0	0	50 GBP	113.35%	63'198.01	0.09	a)
X50497976562	5.7500 % WWUF 5 3/4 03/29/30	0	50	0	50 GBP	103.34%	57'614.27	0.08	a)
X50498768315	6.0000 % HSBC 6 03/29/40 EMTN	150	0	0	150 GBP	98.97%	165'536.85	0.23	a)
X50499449261	5.7500 % ORSTED 5 3/4 04/09/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.94%	113'675.25	0.16	a)
X50519906761	5.7500 % AMXLMM 5 3/4 06/28/30	120	0	0	120 GBP	104.73%	140'131.53	0.19	a)
X50523335395	5.2500 % NOTHLL 5 1/4 07/07/42	100	0	0	100 GBP	97.44%	108'655.18	0.15	a)
X50543369184	6.5000 % LLOYDS 6 1/2 09/17/40 EMTN	160	0	0	160 GBP	114.71%	204'649.34	0.28	a)
X50545440900	5.4450 % TELEFO 5.445 10/08/29 EMTN	50	0	0	50 GBP	102.52%	57'159.32	0.08	a)
X50562107762	5.3750 % ORAFP 5 3/8 11/22/50 EMTN	50	0	0	50 GBP	100.96%	56'287.33	0.08	a)
X50564485273	5.1250 % BGGRP 5 1/8 12/01/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.06%	111'575.56	0.15	a)
X50590171103	5.5000 % THAMES 5 1/2 02/11/41 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50605560084	6.8750 % MUBAUH 6 7/8 03/14/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.52%	114'315.30	0.16	a)
X50625276257	5.8750 % HTHROW 5 7/8 05/13/41 EMTN	200	0	0	200 GBP	103.18%	230'115.88	0.32	a)
X50627336323	5.7500 % NGGLN 5 3/4 04/16/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.16%	115'032.29	0.16	a)
X50629875708	5.2500 % RABOBK 5 1/4 05/23/41 GMTN	100	0	0	100 GBP	103.45%	115'354.55	0.16	a)
X50630584166	5.7500 % TWC 5 3/4 06/02/31	100	0	0	100 GBP	96.49%	107'592.51	0.15	a)
X50633547087	6.3750 % ESBIRE 6 3/8 06/02/26	100	0	0	100 GBP	102.61%	114'420.12	0.16	a)
X50646581404	5.0170 % COMFIN 5.017 07/31/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.99%	111'498.62	0.15	a)
X50649291944	5.8750 % IBESM 5 7/8 07/17/26	100	0	0	100 GBP	101.62%	113'315.08	0.16	a)
X50699618350	5.0000 % AMXLMM 5 10/27/26	100	0	0	100 GBP	100.25%	111'781.85	0.15	a)
X50702029132	5.0000 % BGGRP 5 11/04/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.92%	112'536.76	0.16	a)
X50710091140	5.5000 % AMGN 5 1/2 12/07/26	100	0	0	100 GBP	101.60%	113'295.01	0.16	a)
X50718981995	6.2500 % ABPFN 6 1/4 12/14/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.00%	114'853.88	0.16	a)
X50730243150	4.8750 % ORSTED 4 7/8 01/12/32 EMTN	110	0	0	110 GBP	99.07%	121'517.57	0.17	a)
X50733486848	5.1250 % NWGLN 5 1/8 01/23/42	100	0	0	100 GBP	88.21%	98'358.57	0.14	a)
X50733786130	5.7500 % GATAIR 5 3/4 01/23/37 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.21%	113'975.20	0.16	a)
X50735770637	4.7500 % EOANGR 4 3/4 01/31/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.65%	107'770.92	0.15	a)
X50735781675	4.8750 % SVTLN 4 7/8 01/24/42 EMTN	0	100	0	100 GBP	89.82%	100'160.53	0.14	a)
X50742069726	4.3750 % MOTOPG 4 3/8 02/08/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.00%	110'391.35	0.15	a)
X50753789980	4.3750 % CNALN 4 3/8 03/13/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.81%	109'059.95	0.15	a)
X50755862058	5.2500 % SOUHSG 5 1/4 03/13/43 EMTN	0	100	0	100 GBP	96.30%	107'378.42	0.15	a)
X50776269648	5.0000 % SANCTU 5 04/26/47 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.45%	106'428.37	0.15	a)
X50785710046	4.8750 % T 4 7/8 06/01/44	200	0	0	200 GBP	90.04%	200'793.86	0.28	a)
X50789331948	4.0000 % NGGLN 4 06/08/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.22%	108'412.09	0.15	a)
X50798491113	5.2500 % TWC 5 1/4 07/15/42	100	0	0	100 GBP	82.00%	91'437.30	0.13	a)
X50800186222	4.6250 % THAMES 4 5/8 06/04/46 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50812855277	4.3750 % AMXLMM 4 3/8 08/07/41	200	0	0	200 GBP	88.57%	197'522.23	0.27	a)
X50825385858	4.2500 % CNALN 4 1/4 09/12/44 EMTN	100	0	0	100 GBP	83.34%	92'928.15	0.13	a)
X50827563452	5.2500 % RABOBK 5 1/4 09/14/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.99%	111'499.74	0.15	a)
X50828013838	3.5000 % WFC 3 1/2 09/12/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.90%	104'707.81	0.14	a)
X50829324457	4.0000 % AMGN 4 09/13/29	100	0	0	100 GBP	97.01%	108'170.12	0.15	a)
X50834399981	4.3000 % BHP 4.3 09/25/42 12	100	0	0	100 GBP	87.68%	97'765.35	0.14	a)
X50842152281	4.7500 % GRPLHO 4 3/4 10/22/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.81%	103'485.69	0.14	a)
X50862474029	4.5000 % TGHSG 4 1/2 12/17/42	100	0	0	100 GBP	88.80%	99'013.12	0.14	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.
X50863076930	4.0000 % RIOLN 4 12/11/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.63%	108'862.58	0.15	a)
X50866588527	3.3750 % GSK 3 3/8 12/20/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.45%	108'660.75	0.15	a)
X50866596975	4.2500 % GSK 4 1/4 12/18/45 EMTN	100	0	0	100 GBP	88.84%	99'058.84	0.14	a)
X50866897829	3.5000 % JPM 3 1/2 12/18/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.76%	109'012.00	0.15	a)
X50875301912	3.6250 % SVTLN 3 5/8 01/16/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.74%	108'986.36	0.15	a)
X50876756452	4.3750 % STANLN 4 3/8 01/18/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.03%	102'621.51	0.14	a)
X50888566519	4.3750 % HSRF 4 3/8 11/01/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.58%	104'352.10	0.14	a)
X50903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50914791768	7.0000 % SCTWID 7 06/16/43	100	0	0	100 GBP	105.84%	118'018.47	0.16	a)
X50932036154	4.2500 % T 4 1/4 06/01/43	160	0	0	160 GBP	83.22%	148'465.60	0.21	a)
X50947761556	4.2500 % UNIMAN 4 1/4 07/04/53	100	0	0	100 GBP	88.69%	98'894.92	0.14	a)
X50949169923	6.2690 % AABOND 6.269 07/31/25 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50969574598	4.2500 % EQNR 4 1/4 04/10/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.15%	101'633.55	0.14	a)
X50994433836	4.8000 % WELL 4.8 11/20/28	100	0	0	100 GBP	98.87%	110'249.74	0.15	a)
X51004042575	4.6250 % PEABDY 4 5/8 12/12/53	100	0	0	100 GBP	88.71%	98'916.11	0.14	a)
X51004109150	4.5000 % ASTERT 4 1/2 12/18/43	100	0	0	100 GBP	91.32%	101'830.92	0.14	a)
X51023626671	4.2500 % GS 4 1/4 01/29/26 EMTN	400	0	200	200 GBP	99.27%	221'387.07	0.31	a)
X51030900325	4.7500 % VZ 4 3/4 02/17/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.47%	108'685.29	0.15	a)
X51032630771	4.7500 % MAGAIR 4 3/4 03/31/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.99%	109'269.58	0.15	a)
X51040508597	4.8750 % IMBLN 4 7/8 06/07/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.48%	106'465.17	0.15	a)
X51057530393	4.1250 % MAGAIR 4 1/8 04/02/24 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51069886841	4.6250 % RABOBK 4 5/8 05/23/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.30%	108'496.84	0.15	a)
X51075419694	5.1250 % STANLN 5 1/8 06/06/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.80%	106'818.65	0.15	a)
X51075996907	4.1250 % MCD 4 1/8 06/11/54 GMTN	100	0	0	100 GBP	81.39%	90'750.41	0.13	a)
X51088016206	3.7500 % MOTOPG 3 3/4 07/16/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.21%	109'511.56	0.15	a)
X51120891012	3.8750 % SANUK 3 7/8 10/15/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.20%	106'159.64	0.15	a)
X51131276864	4.1250 % YORKFN 4 1/8 10/31/44	100	0	0	100 GBP	83.26%	92'836.72	0.13	a)
X51134541561	5.4530 % AXASA 5.453 PERP EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51138359663	3.6000 % WBA 3.6 11/20/25	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51139918012	4.5000 % WELL 4 1/2 12/01/34	100	0	0	100 GBP	92.37%	102'998.40	0.14	a)
X51140662575	4.3750 % WHTLEY 4 3/8 11/28/44	100	0	0	100 GBP	88.75%	98'962.94	0.14	a)
X51180063056	2.5000 % SGN 2 1/2 02/03/25 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51205617829	3.5000 % APAAU 3 1/2 03/22/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.58%	102'119.72	0.14	a)
X51242413166	5.1250 % AVLN 5 1/8 06/04/50 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.10%	107'153.17	0.15	a)
X51253559865	4.1250 % KHC 4 1/8 07/01/27	100	0	0	100 GBP	98.54%	109'880.65	0.15	a)
X51269175466	3.0500 % AAPL 3.05 07/31/29	100	0	0	100 GBP	95.19%	106'141.80	0.15	a)
X51269176191	3.6000 % AAPL 3.6 07/31/42	100	0	0	100 GBP	85.90%	95'787.21	0.13	a)
X51275957121	3.7500 % IHGLN 3 3/4 08/14/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.50%	109'833.81	0.15	a)
X51298002244	4.0000 % SGCLN 4 09/29/25	100	0	0	100 GBP	98.02%	109'294.12	0.15	a)
X51310962839	5.3750 % LGEN 5 3/8 10/27/45 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.47%	110'912.09	0.15	a)
X51324911608	4.0000 % BATSLN 4 11/23/55 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51328187627	4.1250 % CRHID 4 1/8 12/02/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.42%	108'628.42	0.15	a)
X51345415472	3.6250 % SANUK 3 5/8 01/14/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.42%	109'744.61	0.15	a)
X51347435577	3.2500 % NWDIE 3 1/4 01/20/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.67%	106'674.80	0.15	a)
X51350965478	2.6250 % LONQUA 2 5/8 05/05/26	100	0	0	100 GBP	96.45%	107'553.48	0.15	a)
X51351950149	3.0000 % CRFUNI 3 12/07/55	100	0	0	100 GBP	68.68%	76'582.26	0.11	a)
X51371533867	3.5000 % THAMES 3 1/2 02/25/28 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51374392717	4.3750 % T 4 3/8 09/14/29	100	0	0	100 GBP	97.50%	108'722.08	0.15	a)
X51377228959	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 03/10/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.99%	98'118.83	0.14	a)
X51387869438	3.3750 % VCXAU 3 3/8 04/07/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.45%	108'659.64	0.15	a)
X51397887537	3.5000 % YBS 3 1/2 04/21/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.95%	109'219.41	0.15	a)
X51404981141	4.8700 % RACLN 4.87 05/06/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.13%	110'531.85	0.15	a)
X51410414954	3.6250 % NXTLN 3 5/8 05/18/28	100	0	0	100 GBP	96.19%	107'262.45	0.15	a)
X51441773121	2.6000 % BFB 2.6 07/07/28	100	0	0	100 GBP	93.38%	104'127.97	0.14	a)
X51457522727	2.0000 % WFC 2 07/28/25 EMTN	200	0	0	200 GBP	97.22%	216'813.03	0.30	a)
X51458411276	2.3000 % BAC 2.3 07/25/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.60%	108'830.24	0.15	a)
X51463242583	2.7500 % HTHROW 2 3/4 08/09/49 EMTN	100	0	0	100 GBP	62.87%	70'108.14	0.10	a)
X51468494239	3.3750 % VOD 3 3/8 08/08/49 EMTN	100	0	0	100 GBP	69.19%	77'153.18	0.11	a)
X51472483772	3.0000 % VOD 3 08/12/56 EMTN	200	0	0	200 GBP	60.51%	134'939.74	0.19	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.
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	300	0	0	300 GBP	95.71%	320'161.57	0.44	a)
XS1473485925	2.6250 % HSBC 2 5/8 08/16/28	200	0	0	200 GBP	91.94%	205'035.61	0.28	a)
XS1480022315	2.1250 % IHGLN 2 1/8 08/24/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.33%	105'186.18	0.15	a)
XS1488409977	2.2500 % BATSLN 2 1/4 09/09/52 EMTN	150	0	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1489364395	2.8750 % WPPLN 2 7/8 09/14/46 EMTN	120	0	0	120 GBP	63.53%	85'014.24	0.12	a)
XS1492680902	2.1250 % CDTFIN 2 1/8 09/22/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.09%	100'459.37	0.14	a)
XS1492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	120	0	0	120 GBP	70.91%	94'889.35	0.13	a)
XS1492681116	2.7500 % CDTFIN 2 3/4 09/22/46 EMTN	220	0	0	220 GBP	62.15%	152'454.45	0.21	a)
XS1499603170	1.8750 % BABLN 1 7/8 10/05/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.65%	104'421.24	0.14	a)
XS1506033239	2.7500 % CBGLN 2 3/4 10/19/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.57%	105'457.14	0.15	a)
XS1529614726	2.7500 % SVTLN 2 3/4 12/05/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	84.77%	94'529.40	0.13	a)
XS1548422846	1.7500 % BASGR 1 3/4 03/11/25 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1558089261	4.8750 % LLYDIN 4 7/8 02/07/47	100	0	0	100 GBP	97.78%	109'026.50	0.15	a)
XS1567174526	3.1250 % MCK 3 1/8 02/17/29	100	0	0	100 GBP	94.00%	104'818.20	0.14	a)
XS1577724492	2.2500 % UNISOU 2 1/4 04/11/57	100	0	0	100 GBP	55.65%	62'049.49	0.09	a)
XS1577762823	2.6250 % MS 2 5/8 03/09/27 GMTN	200	0	0	200 GBP	94.65%	211'072.62	0.29	a)
XS1577961862	2.2500 % PLD 2 1/4 06/30/29	100	0	0	100 GBP	89.56%	99'863.92	0.14	a)
XS1578213933	2.3750 % MOTOPG 2 3/8 03/14/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	85.45%	95'282.08	0.13	a)
XS1579033819	4.0730 % VZ 4.073 06/18/24	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1587946911	2.6250 % URWFP 2 5/8 03/30/29	0	100	0	100 GBP	88.48%	98'666.33	0.14	a)
XS1588768926	2.1250 % URWFP 2 1/8 03/30/25	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1592647264	2.0000 % BUPFIN 2 04/05/24	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1596735701	2.2500 % VW 2 1/4 04/12/25 EMTN	80	0	80	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1602093483	3.0000 % HYDEH 3 05/09/52	100	0	0	100 GBP	67.26%	74'997.74	0.10	a)
XS1608101066	1.3750 % PG 1 3/8 05/03/25	100	0	0	100 GBP	97.73%	108'971.86	0.15	a)
XS1608101652	1.8000 % PG 1.8 05/03/29	100	0	0	100 GBP	90.70%	101'135.11	0.14	a)
XS1620778131	3.0430 % CLEF 3.043 06/30/50 A5	100	0	0	100 GBP	89.23%	99'492.60	0.14	a)
XS1637093920	2.0000 % CPGLN 2 07/03/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.94%	100'292.11	0.14	a)
XS1645518652	3.1840 % ANNFND 3.184 07/12/29 EMTN	150	0	0	150 GBP	89.99%	150'523.47	0.21	a)
XS1645518819	3.9350 % ANNFND 3.935 07/12/47 EMTN	150	0	0	150 GBP	74.04%	123'843.62	0.17	a)
XS1653876869	3.5290 % EVEHOL 3.529 08/07/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	80.55%	89'814.86	0.12	a)
XS1681849300	3.3750 % YBS 3 3/8 09/13/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.04%	103'743.27	0.14	a)
XS1684268524	2.5000 % WBD 2 1/2 09/20/24	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1687484698	2.6250 % LANDLN 2 5/8 09/22/37 EMTN	100	0	0	100 GBP	77.61%	86'545.46	0.12	a)
XS1687484771	2.7500 % LANDLN 2 3/4 09/22/59 EMTN	100	0	0	100 GBP	60.78%	67'778.74	0.09	a)
XS1691441924	3.1250 % GATAIR 3 1/8 09/28/39 EMTN	100	0	0	100 GBP	75.38%	84'056.61	0.12	a)
XS1694779734	2.3750 % NWGLN 2 3/8 10/05/27	100	0	0	100 GBP	90.51%	100'927.71	0.14	a)
XS1694801256	3.2500 % NOTHLL 3 1/4 10/12/48	100	0	0	100 GBP	71.50%	79'727.89	0.11	a)
XS1700429308	3.0000 % ARNDTN 3 10/16/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	83.28%	92'866.83	0.13	a)
XS1706110555	3.1250 % PEABDY 3 1/8 10/31/47	100	0	0	100 GBP	69.64%	77'656.08	0.11	a)
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	100	0	0	100 GBP	83.93%	93'587.16	0.13	a)
XS1710677581	3.2880 % HSCRTW 3.288 11/08/49	100	0	0	100 GBP	71.56%	79'794.80	0.11	a)
XS1713474085	2.5170 % WELLTR 2.517 02/07/2118	220	0	0	220 GBP	52.80%	129'517.35	0.18	a)
XS1713474838	2.5440 % OXUNIV 2.544 12/08/2117	200	0	0	200 GBP	53.10%	118'425.47	0.16	a)
XS1716248197	2.2560 % HSBC 2.256 11/13/26 DIP	200	0	0	200 GBP	96.52%	215'254.16	0.30	a)
XS1718393512	2.8750 % MAGAIR 2 7/8 03/31/39 EMTN	100	0	0	100 GBP	75.45%	84'135.78	0.12	a)
XS1720922415	3.1250 % BRITEL 3 1/8 11/21/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	88.68%	98'881.54	0.14	a)
XS1721762679	3.3750 % UTGLN 3 3/8 11/28/29	100	0	0	100 GBP	91.57%	102'106.34	0.14	a)
XS1726321570	2.2500 % BNZLLN 2 1/4 06/11/25	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1738994596	2.7350 % PFE 2.735 06/15/43 REG5	377	0	0	377 GBP	71.86%	302'095.94	0.42	a)
XS1748699011	3.2500 % BACR 3 1/4 01/17/33 EMTN	200	0	0	200 GBP	85.39%	190'421.43	0.26	a)
XS1775239095	4.0000 % VMUKLN 4 09/25/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.50%	109'834.93	0.15	a)
XS1778775491	3.1250 % LONQUA 3 1/8 02/28/53	0	100	0	100 GBP	67.28%	75'023.39	0.10	a)
XS1787409033	3.2830 % SOUHSO 3.283 03/22/48	100	0	0	100 GBP	70.17%	78'239.27	0.11	a)
XS1790055229	3.3750 % GRILN 3 3/8 04/24/28	150	0	0	150 GBP	92.98%	155'514.55	0.22	a)
XS1795261822	2.8750 % NWG 2 7/8 09/19/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.53%	108'753.30	0.15	a)
XS1795387502	3.1250 % CDTFIN 3 1/8 03/21/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	73.03%	81'438.42	0.11	a)
XS1801843092	2.3750 % LANDLN 2 3/8 03/29/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.86%	104'657.63	0.14	a)
XS1813150247	3.3750 % VMUKLN 3 3/8 04/24/26 GMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1815429342	3.1250 % BRMFRD 3 1/8 05/03/48	100	0	0	100 GBP	71.46%	79'678.83	0.11	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.
XS1820002308	2.5000 % ESBIRE 2 1/2 10/27/25	100	0	0	100 GBP	96.89%	108'038.54	0.15	a)
XS1843433712	2.2500 % FI 2 1/4 07/01/25	100	0	0	100 GBP	97.58%	108'805.71	0.15	a)
XS1843433985	3.0000 % FI 3 07/01/31	100	0	0	100 GBP	88.15%	98'291.67	0.14	a)
XS1843435683	3.3600 % FIS 3.36 05/21/31	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1846644968	2.3500 % CAMBRG 2.35 06/27/2078	100	0	0	100 GBP	54.81%	61'119.51	0.08	a)
XS1853426895	3.1250 % INFLN 3 1/8 07/05/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.39%	107'477.66	0.15	a)
XS1857917188	2.6070 % CONPLS 2.607 03/31/39	200	0	0	200 GBP	84.09%	158'285.65	0.22	a)
XS1859424902	3.1250 % GS 3 1/8 07/25/29 EMTN	150	0	0	150 GBP	93.45%	156'304.02	0.22	a)
XS1862518062	3.0000 % WWUF 3 08/03/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	76.60%	85'411.43	0.12	a)
XS1875300912	3.2500 % PEABDY 3 1/4 09/14/48	100	0	0	100 GBP	70.92%	79'084.49	0.11	a)
XS1879223565	2.9000 % T 2.9 12/04/26 GBP	200	0	0	200 GBP	95.93%	213'936.14	0.30	a)
XS1880442808	3.3750 % QDGASF 3 3/8 09/17/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.57%	99'872.84	0.14	a)
XS1883878883	4.2500 % DPWDU 4 1/4 09/25/30 REGS	100	0	0	100 GBP	94.92%	105'841.84	0.15	a)
XS1888920276	5.6250 % MGMLN 5 5/8 10/20/51	100	0	0	100 GBP	96.07%	107'120.83	0.15	a)
XS1888925747	6.2500 % MGMLN 6 1/4 10/20/68	100	0	0	100 GBP	93.49%	104'245.05	0.14	a)
XS1891174424	3.7500 % DLR 3 3/4 10/17/30	100	0	0	100 GBP	91.75%	102'305.94	0.14	a)
XS1893807120	3.5000 % NGGLN 3 1/2 10/16/26	100	0	0	100 GBP	97.00%	108'165.66	0.15	a)
XS1895640404	2.7500 % AWLN 2 3/4 10/26/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.15%	99'413.43	0.14	a)
XS1910948089	3.3750 % VW 3 3/8 11/16/26	100	0	0	100 GBP	96.48%	107'584.71	0.15	a)
XS1910948592	4.1250 % VW 4 1/8 11/17/31	100	0	0	100 GBP	93.47%	104'230.56	0.14	a)
XS1939253917	3.3750 % BNP 3 3/8 01/23/26 EMTN	200	0	0	200 GBP	97.93%	218'407.59	0.30	a)
XS1948630634	3.1250 % DT 3 1/8 02/06/34 EMTN	70	0	0	70 GBP	87.05%	67'949.46	0.09	a)
XS1953146245	3.0000 % INTNED 3 02/18/26 EMTN	200	0	0	200 GBP	97.40%	217'207.77	0.30	a)
XS1961843171	3.0000 % HSBC 3 07/22/28	200	0	0	200 GBP	94.38%	210'481.63	0.29	a)
XS1963555534	3.1250 % APAAU 3 1/8 07/18/31	100	0	0	100 GBP	87.50%	97'571.33	0.13	a)
XS1963745580	2.9500 % MCD 2.95 03/15/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	85.46%	95'298.80	0.13	a)
XS1967636272	3.3750 % ABESM 3 3/8 11/27/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.27%	107'351.65	0.15	a)
XS1968703345	3.1250 % GLENLN 3 1/8 03/26/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.41%	108'621.73	0.15	a)
XS1979281158	2.5000 % VZ 2 1/2 04/08/31	100	0	0	100 GBP	86.84%	96'833.15	0.13	a)
XS1980255779	3.6250 % ARNDTN 3 5/8 04/10/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	82.17%	91'627.98	0.13	a)
XS1982100643	1.7500 % DGELN 1 3/4 10/12/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.65%	105'546.35	0.15	a)
XS1989383192	2.5000 % TSCOLN 2 1/2 05/02/25 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1989386021	2.5000 % WFC 2 1/2 05/02/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.12%	100'485.02	0.14	a)
XS1991245017	2.8750 % MAGAIR 2 7/8 09/30/44 EMTN	100	0	0	100 GBP	66.62%	74'289.67	0.10	a)
XS1992115524	3.0000 % BACR 3 05/08/26 EMTN	200	0	0	200 GBP	96.90%	216'092.69	0.30	a)
XS1997070864	2.5000 % ORSTED 2 1/2 05/16/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	81.77%	91'179.72	0.13	a)
XS2003500142	3.0000 % HSBC 3 05/29/30	100	0	0	100 GBP	91.06%	101'535.42	0.14	a)
XS2004382136	1.6600 % TTEFP 1.66 07/22/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.96%	105'892.02	0.15	a)
XS2008921277	1.5000 % UNANA 1 1/2 07/22/26	100	0	0	100 GBP	94.70%	105'593.18	0.15	a)
XS2014291707	2.6250 % BRK 2 5/8 06/19/59	200	0	0	200 GBP	59.13%	131'868.82	0.18	a)
XS2021471862	1.7500 % MOTOPG 1 3/4 07/03/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.97%	98'094.30	0.14	a)
XS2022043256	2.0000 % UU 2 07/03/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	77.46%	86'374.86	0.12	a)
XS2029525693	1.6420 % WSTSTR 1.642 08/04/26	100	0	0	100 GBP	92.41%	103'046.35	0.14	a)
XS2031277077	1.7500 % C 1 3/4 10/23/26	150	0	0	150 GBP	93.96%	157'163.75	0.22	a)
XS2044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	100	0	0	100 GBP	93.01%	103'714.28	0.14	a)
XS2049149821	4.0000 % VMUKLN 4 09/03/27 GMTN	100	0	0	100 GBP	97.67%	108'904.95	0.15	a)
XS2049548527	2.3500 % GM 2.35 09/03/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.11%	108'286.09	0.15	a)
XS2049782639	1.4050 % TTEFP 1.405 09/03/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	82.14%	91'591.18	0.13	a)
XS2051734981	2.0000 % NGGLN 2 09/16/38 EMTN	200	0	0	200 GBP	66.62%	148'572.65	0.21	a)
XS2052321176	1.8750 % VZ 1 7/8 09/19/30	100	0	0	100 GBP	84.85%	94'611.92	0.13	a)
XS2052961740	1.2500 % NYLIFE 1 1/4 12/17/26 GMTN	100	0	0	100 GBP	92.82%	103'504.64	0.14	a)
XS2055646678	2.1250 % WFC 2 1/8 09/24/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	83.45%	93'049.70	0.13	a)
XS2057072477	2.6250 % CKHGTH 2 5/8 10/17/34	200	0	0	200 GBP	74.01%	165'042.31	0.23	a)
XS2057835808	1.2500 % HENKEL 1 1/4 09/30/26	100	0	0	100 GBP	93.71%	104'490.37	0.14	a)
XS2061962465	4.8750 % RLMI 4 7/8 10/07/49	100	0	0	100 GBP	82.44%	91'930.16	0.13	a)
XS2066578126	1.3750 % MASSMU 1 3/8 12/15/26 GMTN	100	0	0	100 GBP	92.79%	103'462.27	0.14	a)
XS2068966048	2.0000 % IBESM 2 11/13/31	100	0	0	100 GBP	83.53%	93'138.90	0.13	a)
XS2071735687	2.3750 % SVNLN 2 3/8 11/04/48	100	0	0	100 GBP	60.58%	67'552.38	0.09	a)
XS2083961370	3.7500 % LGEN 3 3/4 11/26/49 EMTN	200	0	0	200 GBP	90.72%	202'317.05	0.28	a)
XS2100729776	1.2500 % RABOBK 1 1/4 01/14/25 GMTN	100	0	100	0 GBP	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.
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.63%	104'398.94	0.14	a)
XS2102293029	2.7500 % LOGICR 2 3/4 01/15/30	100	0	0	100 GBP	85.48%	95'313.30	0.13	a)
XS2102388597	2.5000 % ISPIM 2 1/2 01/15/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.57%	97'643.81	0.14	a)
XS2105779800	1.8750 % CLARHG 1 7/8 01/22/35 EMTN	200	0	0	200 GBP	74.05%	165'144.90	0.23	a)
XS2105811116	1.8750 % ESBIRE 1 7/8 07/21/35 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.31%	82'859.02	0.11	a)
XS2114853299	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/20/29	200	0	0	200 GBP	88.23%	196'757.29	0.27	a)
XS2114853455	1.8750 % CMCSA 1 7/8 02/20/36	200	0	0	200 GBP	73.41%	163'704.22	0.23	a)
XS2115092442	1.3750 % GLCCUK 1 3/8 03/31/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.09%	82'613.71	0.11	a)
XS2118273866	1.0000 % SIEGR 1 02/20/25 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2120087452	1.7500 % SANTAN 1 3/4 02/17/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.48%	103'126.63	0.14	a)
XS2133453626	2.8570 % SOUHSG 2.857 10/07/35	100	0	0	100 GBP	79.40%	88'533.64	0.12	a)
XS2147890607	2.8750 % DGELN 2 7/8 03/27/29	100	0	0	100 GBP	94.09%	104'921.91	0.15	a)
XS2150090764	3.2500 % EXPNLN 3 1/4 04/07/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.07%	101'552.15	0.14	a)
XS2154346642	2.3750 % SANCTU 2 3/8 04/14/50	100	0	0	100 GBP	59.94%	66'837.62	0.09	a)
XS2158692538	2.0000 % GUINNE 2 04/22/55	100	0	0	100 GBP	50.27%	56'051.50	0.08	a)
XS2163089563	2.7500 % TSCOLN 2 3/4 04/27/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.68%	99'995.50	0.14	a)
XS2166022934	4.5000 % LGEN 4 1/2 11/01/50	200	0	0	200 GBP	92.28%	205'793.86	0.28	a)
XS2170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.05%	82'575.79	0.11	a)
XS2172960481	3.6220 % NWG 3.622 08/14/30	200	0	0	200 GBP	98.45%	219'553.89	0.30	a)
XS2176795677	3.7500 % BACR 3 3/4 11/22/30	100	0	0	100 GBP	97.48%	108'694.21	0.15	a)
XS2177006983	1.7500 % RKTLN 1 3/4 05/19/32 REGS	100	0	0	100 GBP	80.42%	89'671.02	0.12	a)
XS2178611526	3.7500 % IILN 3 3/4 06/05/40	100	0	0	100 GBP	79.18%	88'295.02	0.12	a)
XS2180916525	2.3750 % SWSFIN 2 3/8 05/28/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	79.57%	88'723.21	0.12	a)
XS2180916871	3.0000 % SWSFIN 3 05/28/37 EMTN	100	0	0	100 GBP	65.90%	73'480.12	0.10	a)
XS2181348405	4.0000 % AVLN 4 06/03/55	100	0	0	100 GBP	82.70%	92'215.62	0.13	a)
XS2183141717	1.7500 % BUPFIN 1 3/4 06/14/27	100	0	0	100 GBP	91.75%	102'309.28	0.14	a)
XS2185883100	5.1480 % ISPIM 5.148 06/10/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	94.37%	105'225.21	0.15	a)
XS2190040100	4.1250 % BUPFIN 4 1/8 06/14/35	100	0	0	100 GBP	82.73%	92'252.42	0.13	a)
XS2193663619	4.2500 % BPLN 4 1/4 PERP	200	0	0	200 GBP	96.50%	215'209.55	0.30	a)
XS2194483330	2.7420 % EVEHOL 2.742 06/30/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	84.57%	77'378.45	0.11	a)
XS2195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	100	0	0	100 GBP	97.27%	108'458.92	0.15	a)
XS2208638838	1.4150 % NVENET 1.415 07/30/30	100	0	0	100 GBP	82.22%	91'678.15	0.13	a)
XS2227898421	5.1250 % VMUKLN 5 1/8 12/11/30 GMTN	100	0	0	100 GBP	99.05%	110'447.10	0.15	a)
XS2228291279	1.0000 % RDSALN 1 12/10/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	81.75%	91'155.18	0.13	a)
XS2228387465	1.7500 % RDSALN 1 3/4 09/10/52 EMTN	100	0	0	100 GBP	50.05%	55'811.75	0.08	a)
XS2231790960	1.1250 % BRBYLN 1 1/8 09/21/25	100	0	0	100 GBP	95.52%	106'508.66	0.15	a)
XS2233154454	1.0000 % COVBS 1 09/21/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.82%	106'845.41	0.15	a)
XS2237991240	0.7390 % EXPNLN 0.739 10/29/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.10%	106'045.90	0.15	a)
XS2238341080	1.6250 % O 1 5/8 12/15/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	81.30%	90'656.75	0.13	a)
XS2239766624	2.0000 % SKIPTN 2 10/02/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.37%	107'454.24	0.15	a)
XS2240066915	1.2500 % DGELN 1 1/4 03/28/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	77.38%	86'287.88	0.12	a)
XS2243322976	2.7500 % HTHROW 2 3/4 10/13/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.88%	101'332.48	0.14	a)
XS2244418609	1.0000 % ENELIM 1 10/20/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.40%	99'688.86	0.14	a)
XS2249596565	1.5000 % BNZLLN 1 1/2 10/30/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	82.71%	92'223.43	0.13	a)
XS2251337353	1.1250 % VZ 1 1/8 11/03/28	100	0	0	100 GBP	87.16%	97'184.40	0.13	a)
XS2251337601	1.8750 % VZ 1 7/8 11/03/38	200	0	0	200 GBP	66.71%	148'782.28	0.21	a)
XS2257848098	1.2500 % CLARHG 1 1/4 11/13/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	75.35%	84'017.59	0.12	a)
XS2259211485	2.0000 % ORBCAP 2 11/24/38	100	0	0	100 GBP	68.48%	76'363.71	0.11	a)
XS2260426288	0.7500 % TOYOTA 0 3/4 11/19/26	100	0	0	100 GBP	91.92%	102'498.85	0.14	a)
XS2264159471	1.7500 % ATH 1 3/4 11/24/27	100	0	0	100 GBP	90.09%	100'459.37	0.14	a)
XS2264545273	0.7500 % HNDA 0 3/4 11/25/26	100	0	0	100 GBP	92.16%	102'766.46	0.14	a)
XS2265524640	2.7070 % LLOYDS 2.707 12/03/35	100	0	0	100 GBP	83.12%	92'686.18	0.13	a)
XS2279783760	1.2500 % YTLPMK 1 1/4 01/12/36	100	0	0	100 GBP	61.96%	69'086.73	0.10	a)
XS2285179763	0.7500 % NYLIFE 0 3/4 12/14/28 GMTN	200	0	0	200 GBP	85.64%	190'992.35	0.26	a)
XS2287624154	1.5000 % MOTOPG 1 1/2 01/20/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	60.15%	67'067.33	0.09	a)
XS2291328735	0.8750 % UU 0 7/8 10/28/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	81.63%	91'021.38	0.13	a)
XS2293681685	2.5000 % ORSTED 2 1/2 02/18/3021 GBP	100	0	0	100 GBP	73.13%	81'539.89	0.11	a)
XS2303762475	1.8750 % DB 1 7/8 12/22/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.88%	100'217.40	0.14	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.
XS2305598216	1.1250 % INTNED 1 1/8 12/07/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.25%	99'520.48	0.14	a)
XS2312756062	2.6250 % ISPI2 2 5/8 03/11/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.46%	83'032.98	0.11	a)
XS2317082787	2.6250 % HTHROW 2 5/8 03/16/28	100	0	0	100 GBP	91.33%	101'834.26	0.14	a)
XS2322254322	1.5000 % GS 1 1/2 12/07/27 EMTN	140	0	0	140 GBP	90.18%	140'780.50	0.19	a)
XS2322315727	1.7500 % HSBC 1 3/4 07/24/27	200	0	0	200 GBP	94.04%	209'732.30	0.29	a)
XS2327297672	1.6250 % LSELN 1 5/8 04/06/30	100	0	0	100 GBP	86.09%	95'991.27	0.13	a)
XS2329146539	1.1250 % MQGAU 1 1/8 12/15/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.12%	106'061.51	0.15	a)
XS2331739750	1.5000 % SANTAN 1 1/2 04/14/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.80%	105'704.69	0.15	a)
XS2332199830	2.5000 % GATAIR 2 1/2 04/15/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	88.35%	98'519.14	0.14	a)
XS2333224314	1.7500 % KEL 1 3/4 10/27/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	73.65%	82'127.53	0.11	a)
XS2335966557	1.8950 % JPM 1.895 04/28/33 EMTN	400	0	300	100 GBP	82.14%	91'594.52	0.13	a)
XS2335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2335988957	1.7500 % NATSER 1 3/4 09/30/33	100	0	0	100 GBP	77.97%	86'937.97	0.12	a)
XS2337346162	2.0000 % PARTSY 2 05/07/36	100	0	0	100 GBP	71.06%	79'231.68	0.11	a)
XS2343114331	1.6250 % UNCOLO 1 5/8 06/04/61	100	0	0	100 GBP	46.37%	51'709.39	0.07	a)
XS2345981802	1.1250 % UBS 1 1/8 12/15/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.21%	106'161.87	0.15	a)
XS2346516250	2.1050 % NWG 2.105 11/28/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.14%	103'857.01	0.14	a)
XS2348234936	1.6670 % BAC 1.667 06/02/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.01%	99'257.32	0.14	a)
XS2348693297	1.5000 % CABKSM 1 1/2 12/03/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.38%	106'350.32	0.15	a)
XS2349738190	2.0000 % ANCHAN 2 07/21/51	100	0	0	100 GBP	52.82%	58'901.63	0.08	a)
XS2351166421	1.9850 % LLOYDS 1.985 12/15/31	100	0	0	100 GBP	92.88%	103'570.43	0.14	a)
XS2353399780	1.8090 % ANZ 1.809 09/16/31	100	0	0	100 GBP	92.85%	103'533.64	0.14	a)
XS2354308194	1.3750 % NESNVX 1 3/8 06/23/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	77.85%	86'813.08	0.12	a)
XS2355059911	1.8750 % GS 1 7/8 12/16/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	83.68%	93'306.17	0.13	a)
XS2359291049	1.8750 % CLARHG 1 7/8 09/07/51 EMTN	100	0	0	100 GBP	50.67%	56'498.64	0.08	a)
XS2364124664	1.7500 % O 1 3/4 07/13/33	100	0	0	100 GBP	76.01%	84'759.11	0.12	a)
XS2364425863	1.8750 % INVPLN 1 7/8 07/16/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.98%	100'338.95	0.14	a)
XS2365671259	0.7500 % TOYOTA 0 3/4 12/19/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.98%	105'907.63	0.15	a)
XS2384288747	1.5000 % GM 1.55 07/30/27	100	0	0	100 GBP	90.61%	101'041.44	0.14	a)
XS2384289554	2.5000 % QBEAU 2 1/2 09/13/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.93%	98'045.24	0.14	a)
XS2384698721	1.0000 % BMO 1 09/09/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.74%	103'408.75	0.14	a)
XS2385061234	1.0000 % RY 1 09/09/26 EMTN	0	100	0	100 GBP	92.83%	103'512.45	0.14	a)
XS2385120857	1.1620 % EJRAIL 1.162 09/15/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.37%	97'423.02	0.13	a)
XS2385122630	1.6250 % NDAFH 1 5/8 12/09/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.13%	99'381.10	0.14	a)
XS2386287416	1.6990 % NAB 1.699 09/15/31 GMTN	100	0	0	100 GBP	92.67%	103'328.46	0.14	a)
XS2389042263	1.7500 % UKPONE 1 3/4 09/30/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.73%	83'334.05	0.12	a)
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	0	200	0	200 GBP	90.13%	200'992.34	0.28	a)
XS2393518597XXX	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2393539080	1.3750 % OPBANK 1 3/8 09/04/26 GMTN	100	0	0	100 GBP	93.10%	103'813.52	0.14	a)
XS2393618389	2.3080 % ANNFND 2.308 10/06/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	78.47%	87'498.85	0.12	a)
XS2393618462	2.9240 % ANNFND 2.924 10/06/51 EMTN	100	0	0	100 GBP	58.45%	65'176.16	0.09	a)
XS2393629311	2.6250 % INVPLN 2 5/8 01/04/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.51%	100'924.36	0.14	a)
XS2393975813	1.3750 % LEED 1 3/8 10/06/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.16%	100'531.85	0.14	a)
XS2398746227	2.6250 % BPPEHX 2 5/8 10/20/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	88.74%	98'955.14	0.14	a)
XS2399232169	1.5000 % HNDA 1 1/2 10/19/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.27%	101'772.93	0.14	a)
XS2405139432	2.0570 % NWG 2.057 11/09/28	100	0	0	100 GBP	91.47%	101'995.95	0.14	a)
XS2429208056	1.6250 % MET 1 5/8 10/12/28 GMTN	100	0	0	100 GBP	88.94%	99'178.15	0.14	a)
XS2429208999	1.8750 % RABOBK 1 7/8 07/12/28	100	0	0	100 GBP	92.25%	102'865.71	0.14	a)
XS2429214294	1.5000 % NYLIFE 1 1/2 07/15/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.82%	102'383.99	0.14	a)
XS2430702105	2.0000 % LONQUA 2 03/31/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	80.67%	89'949.79	0.12	a)
XS2431784441	2.1250 % MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	66.11%	73'714.29	0.10	a)
XS2432519317	2.4210 % SANUK 2.421 01/17/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.63%	102'168.78	0.14	a)
XS2433140113	2.1250 % VW 2 1/8 01/18/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.74%	101'183.06	0.14	a)
XS2435102285	2.5000 % NBHA 2 1/2 01/26/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.96%	83'589.40	0.12	a)
XS2437353514	1.8750 % CM 1 7/8 01/27/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.99%	107'038.32	0.15	a)
XS2441259137	2.8750 % SGELN 2 7/8 02/08/34	100	0	0	100 GBP	83.26%	92'837.83	0.13	a)
XS2441652901	2.5000 % ABFLN 2 1/2 06/16/34	100	0	0	100 GBP	82.78%	92'302.60	0.13	a)
XS2445848539	2.7500 % PEABDY 2 3/4 03/02/34	100	0	0	100 GBP	82.18%	91'635.78	0.13	a)
XS2449910921	3.6190 % NWG 3.619 03/29/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.44%	106'417.22	0.15	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.
XS2450068379	3.1250 % SANTAN 3 1/8 10/06/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.75%	108'998.62	0.15	a)
XS2453741279	2.7500 % BAZFIN 2 3/4 03/10/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	79.68%	88'845.86	0.12	a)
XS2462446696	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/29/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	84.33%	94'034.31	0.13	a)
XS2464407514	2.1250 % NESNVX 2 1/8 04/04/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.51%	105'383.55	0.15	a)
XS2464407860	2.5000 % NESNVX 2 1/2 04/04/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.81%	97'912.54	0.14	a)
XS2464724165	2.8750 % TD 2 7/8 04/05/27 EMTN	200	0	0	200 GBP	95.01%	211'891.09	0.29	a)
XS2465774474	2.6250 % DNBNO 2 5/8 06/10/26	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2465987621	2.8750 % BNS 2 7/8 05/03/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.89%	105'808.39	0.15	a)
XS2466363202	2.8750 % ENELIM 2 7/8 04/11/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.00%	102'583.59	0.14	a)
XS2466406530	2.7500 % DGELN 2 3/4 06/08/38	100	0	0	100 GBP	79.06%	88'153.40	0.12	a)
XS2467494774	3.5110 % YBS 3.511 10/11/30	100	0	0	100 GBP	92.40%	103'036.31	0.14	a)
XS2468855593	3.2500 % VW 3 1/4 04/13/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.38%	106'351.43	0.15	a)
XS2471771753	4.8750 % BPPEHX 4 7/8 04/29/32	100	0	0	100 GBP	91.96%	102'545.68	0.14	a)
XS2472657084	3.5840 % BAC 3.584 04/27/31	100	0	0	100 GBP	93.64%	104'411.20	0.14	a)
XS2473721210	3.6250 % GS 3 5/8 10/29/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.14%	106'084.93	0.15	a)
XS2487052727	4.0800 % MQGAU 4.08 05/31/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.95%	108'111.02	0.15	a)
XS2490729154	3.6250 % RY 3 5/8 06/14/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.79%	107'927.03	0.15	a)
XS2491156902	7.3750 % AABOND 7 3/8 07/31/29 EMTN	0	100	0	100 GBP	104.31%	116'310.17	0.16	a)
XS2495087137	5.0000 % RTOLN 5 06/27/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.67%	110'027.84	0.15	a)
XS2496032108	3.9200 % TOYOTA 3.92 06/28/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.13%	109'423.47	0.15	a)
XS2503832078	3.5500 % PEP 3.55 07/22/34	100	0	0	100 GBP	92.77%	103'450.01	0.14	a)
XS2521025408	4.0000 % DNBNO 4 08/17/27 EMTN	200	0	0	200 GBP	98.13%	218'833.55	0.30	a)
XS2523511165	4.6250 % SHBASS 4 5/8 08/23/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.25%	108'441.08	0.15	a)
XS2523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	200	0	0	200 GBP	96.62%	215'481.63	0.30	a)
XS2531570112	5.3750 % ORSTED 5 3/8 09/13/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.82%	109'077.79	0.15	a)
XS2540612129	6.3750 % NWG 6 3/8 11/08/27 EMTN	200	0	0	200 GBP	104.40%	232'821.06	0.32	a)
XS2552367687	8.4070 % BACR 8.407 11/14/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.33%	118'561.51	0.16	a)
XS2553549903	8.2010 % HSBC 8.201 11/16/34	100	0	0	100 GBP	109.79%	122'427.47	0.17	a)
XS2555706337	7.2720 % SWEDA 7.272 11/15/32	100	0	0	100 GBP	104.25%	116'246.61	0.16	a)
XS2555708036	7.0980 % SANUK 7.098 11/16/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.75%	115'689.07	0.16	a)
XS2558389891	5.7890 % MS 5.789 11/18/33	200	0	0	200 GBP	104.60%	233'273.78	0.32	a)
XS2560496197	5.1250 % VOD 5 1/8 12/02/52 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.74%	101'179.71	0.14	a)
XS2560994381	8.6250 % CMZB 8 5/8 02/28/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	107.75%	120'149.38	0.17	a)
XS2562898143	6.1780 % NWIDE 6.178 12/07/27	100	0	0	100 GBP	102.36%	114'138.00	0.16	a)
XS2563349765	7.4160 % NWG 7.416 06/06/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.94%	117'017.13	0.16	a)
XS2565082901	5.2480 % PL 5.248 01/13/28 GMTN	100	0	0	100 GBP	101.70%	113'399.82	0.16	a)
XS2569776136	5.1250 % YTLPMK 5 1/8 10/31/32	100	0	0	100 GBP	93.05%	103'756.65	0.14	a)
XS2570858303	5.0000 % MET 5 01/10/30	0	100	0	100 GBP	101.40%	113'070.88	0.16	a)
XS2570940226	6.3690 % BACR 6.369 01/31/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.59%	116'622.39	0.16	a)
XS2574218561	5.0000 % PACLIF 5 01/12/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.91%	112'517.80	0.16	a)
XS2575155671	7.7500 % UBS 7 3/4 03/10/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.01%	115'977.88	0.16	a)
XS2578939527	5.0000 % RY 5 01/24/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.67%	112'255.76	0.16	a)
XS2579488201	6.8750 % CABKSM 6 7/8 10/25/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.00%	114'852.77	0.16	a)
XS2579493037	5.1250 % SANTAN 5 1/8 01/25/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.03%	112'653.84	0.16	a)
XS2580220171	8.4500 % AABOND 8.45 01/31/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.25%	118'476.76	0.16	a)
XS2582814385	5.7500 % BRITEL 5 3/4 02/13/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.11%	112'747.50	0.16	a)
XS2583743047	4.8750 % IBM 4 7/8 02/06/38	100	0	0	100 GBP	96.22%	107'295.90	0.15	a)
XS2585804946	4.5000 % NWGLN 4 1/2 02/14/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	92.83%	103'516.91	0.14	a)
XS2586741543	4.6250 % DANBNK 4 5/8 04/13/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.88%	111'368.16	0.15	a)
XS2588986724	6.2500 % INTNED 6 1/4 05/20/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.88%	113'598.31	0.16	a)
XS2590262296	5.1250 % ABNAV 5 1/8 02/22/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.83%	112'428.59	0.16	a)
XS2591847970	6.6250 % LLOYDS 6 5/8 06/02/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.37%	114'152.50	0.16	a)
XS2592017300	6.1250 % DB 6 1/8 12/12/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.63%	114'434.61	0.16	a)
XS2594990892	5.6280 % MIZUHO 5.628 06/13/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.26%	114'030.96	0.16	a)
XS2595035234	6.8600 % F 6.86 06/05/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.13%	113'886.00	0.16	a)
XS2597544290	4.8750 % LANDLN 4 7/8 09/15/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.07%	112'696.21	0.16	a)
XS2603557674	6.1360 % CPKLN 6.136 08/28/31	100	0	0	100 GBP	102.27%	114'034.30	0.16	a)
XS2607194086	5.2500 % SVTLN 5 1/4 04/04/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.79%	109'042.11	0.15	a)
XS2608701574	5.1250 % UU 5 1/8 10/06/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.20%	106'152.95	0.15	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.
XS2622198955	5.8750 % VW 5 7/8 05/23/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.95%	114'794.78	0.16	a)
XS2623504102	6.5000 % INCHLN 6 1/2 06/09/28	100	0	0	100 GBP	103.32%	115'207.36	0.16	a)
XS2625137265	5.8750 % SWEDA 5 7/8 05/24/29 GMTN	100	0	0	100 GBP	102.75%	114'574.00	0.16	a)
XS2626254515	5.2500 % ABNAV 5 1/4 05/26/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.71%	112'293.67	0.16	a)
XS2629368999	5.5000 % SEB 5 1/2 06/01/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.55%	113'232.56	0.16	a)
XS2629395612	5.7730 % BPLN 5.773 05/25/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.21%	118'431.04	0.16	a)
XS2630420268	6.6250 % ISPI 6 5/8 05/31/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.71%	118'987.47	0.16	a)
XS2630776875	5.5000 % BMW 5 1/2 06/06/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.46%	113'129.98	0.16	a)
XS2638082664	6.1250 % VLVY 6 1/8 06/22/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.59%	116'626.85	0.16	a)
XS2638381819	6.0000 % AWLN 6 06/20/39 GMTN	100	0	0	100 GBP	102.09%	113'835.82	0.16	a)
XS2638487566	6.6250 % NWG 6 5/8 06/22/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.99%	114'838.27	0.16	a)
XS2641168997	5.7500 % UU 5 3/4 06/26/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.85%	114'679.93	0.16	a)
XS2659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.94%	113'667.44	0.16	a)
XS2667547876	5.6250 % MBGGR 5 5/8 08/17/26 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.55%	113'231.45	0.16	a)
XS2667627124	5.7200 % CAT 5.72 08/17/26 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.94%	113'667.44	0.16	a)
XS2669894821	6.1250 % NWDIE 6 1/8 08/21/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.43%	116'442.86	0.16	a)
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.63%	116'664.76	0.16	a)
XS2674597468	8.2500 % BBVASM 8 1/4 11/30/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	107.88%	120'288.76	0.17	a)
XS2678308516	5.7500 % MOTOPG 5 3/4 09/11/48 EMTN	100	0	0	100 GBP	105.19%	117'291.44	0.16	a)
XS2678312203	5.8750 % UKPONE 5 7/8 11/15/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.96%	117'036.08	0.16	a)
XS2680897050	6.6250 % SGN 6 5/8 03/14/35 EMTN	100	0	0	100 GBP	108.74%	121'248.84	0.17	a)
XS2681391251	5.6250 % RKTLN 5 5/8 12/14/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.34%	114'115.70	0.16	a)
XS2685873908	6.8000 % HSBC 6.8 09/14/31	200	0	0	200 GBP	108.12%	241'128.37	0.33	a)
XS2687917018	6.5000 % VW 6 1/2 09/18/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.58%	115'497.28	0.16	a)
XS2689044258	5.2500 % NESNVX 5 1/4 09/21/26	100	0	0	100 GBP	101.30%	112'959.37	0.16	a)
XS2689046626	5.1250 % NESNVX 5 1/8 09/21/32	0	100	0	100 GBP	104.52%	116'546.57	0.16	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	100	0	0	100 GBP	104.56%	116'587.82	0.16	a)
XS2703627021	5.1250 % DE 5 1/8 10/18/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.61%	114'417.89	0.16	a)
XS2707822644	8.2500 % THAMES 8 1/4 04/25/40	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2711945878	7.0900 % BACR 7.09 11/06/29	200	0	0	200 GBP	106.74%	238'055.22	0.33	a)
XS2724943639	5.1250 % NESNVX 5 1/8 12/07/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.28%	115'161.64	0.16	a)
XS2725781509	6.2500 % NBHA 6 1/4 12/06/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.45%	118'695.32	0.16	a)
XS2728570834	6.0000 % O 6 12/05/39	100	0	0	100 GBP	105.72%	117'881.31	0.16	a)
XS2729188644	5.3750 % PACLIF 5 3/8 11/30/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.49%	114'286.31	0.16	a)
XS2729355649	6.0000 % CAABNK 6 12/06/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.55%	113'235.91	0.16	a)
XS2731297235	7.3750 % SWSFIN 7 3/8 12/12/41	100	0	0	100 GBP	87.49%	97'559.06	0.13	a)
XS2741328681	5.5000 % SVNLN 5 1/2 01/24/57 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.46%	113'131.09	0.16	a)
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.83%	113'545.90	0.16	a)
XS2747270986	8.8750 % OSBLN 8 7/8 01/16/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	107.98%	120'406.96	0.17	a)
XS2747603624	5.5000 % SSELN 5 1/2 01/15/44 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.80%	110'171.68	0.15	a)
XS2748853194	5.3750 % SANTAN 5 3/8 01/17/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.76%	113'471.19	0.16	a)
XS277468674	5.8750 % COVBS 5 7/8 03/12/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.66%	113'355.22	0.16	a)
XS2778383971	5.7500 % AWLN 5 3/4 06/07/43 GMTN	0	100	0	100 GBP	97.24%	108'433.28	0.15	a)
XS2790094523	5.8510 % BACR 5.851 03/21/35	0	100	0	100 GBP	100.67%	112'257.99	0.16	a)
XS2805328601	7.0190 % ROTHLF 7.019 12/10/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	102.06%	113'800.14	0.16	a)
XS2811733240	4.8750 % NYLIFE 4 7/8 04/30/31 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.21%	112'857.90	0.16	a)
XS2823261248	6.8500 % AABOND 6.85 07/31/31 EMTN	0	100	0	100 GBP	102.17%	113'926.14	0.16	a)
XS2823302026	4.7500 % TOYOTA 4 3/4 10/22/29 EMTN	0	100	0	100 GBP	100.26%	111'798.58	0.15	a)
XS2828827449	5.7500 % UU 5 3/4 05/28/51 EMTN	0	100	0	100 GBP	97.63%	108'859.24	0.15	a)
XS2838520836	5.7500 % MOTOPG 5 3/4 06/17/51 EMTN	0	100	0	100 GBP	104.34%	116'345.85	0.16	a)
XS2870909863	6.3750 % PNNLN 6 3/8 08/05/41 EMTN	0	100	0	100 GBP	103.31%	115'196.21	0.16	a)
GBP							60'775'548.19	84.07	
JP316572BMA4	0.1000 % NTT 0.1 09/18/26 21	100'000	0	0	100'000 JPY	98.96%	576'652.67	0.80	a)
JP316572CLC0	0.2800 % NTT 0.28 12/20/27 17	100'000	0	0	100'000 JPY	98.80%	575'702.86	0.80	a)
JP322860BM99	0.3700 % KANSEL 0.37 09/19/31 541	100'000	0	0	100'000 JPY	95.32%	555'424.66	0.77	a)
JP363360APA1	0.3700 % TOYOTA 0.37 10/13/26 100	100'000	0	0	100'000 JPY	99.57%	580'195.53	0.80	a)
JP364300AL75	0.0700 % CENEXP 0.07 07/10/25 84	100'000	0	0	100'000 JPY	99.71%	581'040.46	0.80	a)
JP364300AP55	0.3850 % CENEXP 0.385 05/18/28 100	0	100'000	0	100'000 JPY	99.28%	578'528.99	0.80	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.
JP364300AP89	0.4390 % CENEXP 0.439 08/17/28 101	100'000	0	0	100'000 JPY	99.36%	578'971.85	0.80	a)
JP365820BM97	0.0400 % WESEXP 0.04 06/19/26 61	100'000	0	0	100'000 JPY	99.18%	577'934.63	0.80	a)
JP365820BN88	0.2250 % WESEXP 0.225 06/18/27 69	100'000	0	0	100'000 JPY	99.15%	577'771.47	0.80	a)
JP365820CP51	0.3900 % WESEXP 0.39 05/25/28 77	100'000	0	0	100'000 JPY	99.29%	578'593.09	0.80	a)
JP379990BL44	0.2250 % EASEXP 0.225 04/24/30 69	100'000	0	0	100'000 JPY	97.40%	567'579.93	0.79	a)
JP379990BQ72	0.7580 % EASEXP 0.758 07/25/29 114	0	100'000	0	100'000 JPY	100.46%	585'364.14	0.81	a)
JP525022AM69	0.5140 % ACAFP 0.514 07/06/27 9	100'000	0	0	100'000 JPY	98.96%	576'623.54	0.80	a)
JP582667AN51	1.2470 % LLOYDS 1.247 05/26/28 10	100'000	0	0	100'000 JPY	100.25%	584'163.77	0.81	a)
XS0233761138	2.4000 % C 2.4 10/31/25 INTL	10'000	0	0	10'000 JPY	101.73%	59'275.87	0.08	a)
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	15'000	0	0	15'000 JPY	104.16%	91'044.76	0.13	a)
XS1999735688	0.7690 % MET 0.769 05/23/29	100'000	0	0	100'000 JPY	97.84%	570'126.36	0.79	a)
XS2049404366	0.4400 % BRK 0.44 09/13/29	100'000	0	0	100'000 JPY	96.46%	562'079.17	0.78	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	98.71%	575'160.94	0.80	a)
JPY							9'932'234.69	13.74	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

GBP/JPY Verfall 07.05.2024	40'000'000	203'155	JPY/GBP	0.00	0.00
GBP/JPY Verfall 05.08.2024	17'000'000	88'006	JPY/GBP	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	387'848.58	0.54
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	70'707'782.88	97.81
Sonstige Vermögenswerte	1'195'414.90	1.65
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	72'291'046.36	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-227.94	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	72'290'818.42	

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);	70'707'782.88	97.81
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

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

GBP	1 = CHF	1.11507541
JPY	100 = CHF	0.58270700

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2024 - 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 - 0.60	-	0.552	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.552	-	-	-

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2024 - 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	0.310	0.500	0.210	0.100	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.

8 Benchmark

FTSE Non-EUR, Non-USD World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index TR

9 TER

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

10 Fussnoten

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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.