

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. CHF RESPONSIBLE

## Halbjahresbericht per 31.08.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA CHF	111719600	CHF
GA CHF	116358348	CHF
GT CHF	111719601	CHF
NT CHF	111719603	CHF
ST CHF	111719602	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	20
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	21
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	21
7	Pauschale Verwaltungskommission	22
8	Benchmark	22
9	TER	22
10	Fussnoten	23
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	24

# 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	27.02.2021
	bis	31.08.2024	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'142'798'567.04	2'379'789'738.54	1'884'778'958.66	1'842'894'072.08
<b>Klasse FA CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		34'814'450.23	21'132'580.92	3'469'808.32	564'721.99
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		359'886.206	222'144.632	37'958.533	5'867.800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.7374	95.1298	91.4105	96.2408
Ausschüttung je Anteil		-	0.95	0.85	-
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
<b>Klasse GA CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'199'449.79	2'488'848.73	18'632'525.09	9'922.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		21'969.736	25'281.311	197'625.190	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.1127	98.4462	94.2821	99.2237
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		106.5989	103.3140	94.8555	96.2885
Ausschüttung je Anteil		-	1.00	0.60	-
Total Expense Ratio (TER)		0.12 %	0.12 %	0.12 %	0.12 %
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		62'993'685.80	47'114'595.65	129'729'969.21	57'207'789.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		642'547.183	491'972.930	1'420'173.676	594'276.823
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.0374	95.7666	91.3480	96.2645
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		104.3892	100.5020	91.9035	93.4168
Thesaurierung je Anteil		-	0.96	0.60	0.34
Total Expense Ratio (TER)		0.12 %	0.12 %	0.12 %	0.12 %
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'042'790'981.22	2'309'053'713.24	1'732'946'656.04	1'785'111'638.42
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		30'955'266.733	24'052'446.723	18'939'354.292	18'529'941.359
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.2964	96.0008	91.4998	96.3366
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		104.6649	100.7477	92.0562	93.4868
Thesaurierung je Anteil		-	1.07	0.71	0.41
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 (Lancierung 16.07.2021)	2.71 %	5.72 %	-8.57 %	-0.80 %
Klasse GA CHF (Lancierung 23.02.2022)	2.73 %	5.76 %	-6.46 %	-
Klasse GT CHF (Lancierung 16.07.2021)	2.73 %	5.76 %	-8.53 %	-0.79 %
Klasse NT CHF (Lancierung 16.07.2021)	2.79 %	5.89 %	-8.42 %	-0.73 %
Klasse ST CHF (Lancierung 16.07.2021, Schliessung 08.10.2021)	-	-	-	-0.61 %
Benchmark	2.64 %	5.70 %	-8.99 %	-0.75 %
Tracking Error 33)	-	0.11 %	0.56 %	0.79 %

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 (Lancierung 16.07.2021)	0.07 %
Klasse GA CHF (Lancierung 23.02.2022)	0.09 %
Klasse GT CHF (Lancierung 16.07.2021)	0.09 %
Klasse NT CHF (Lancierung 16.07.2021)	0.15 %

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	2'819'551.30	4'979'011.89
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'115'178'181.67	2'356'802'928.11
Sonstige Vermögenswerte	24'811'583.35	18'017'057.57
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'142'809'316.32</b>	<b>2'379'798'997.57</b>
Andere Verbindlichkeiten	-10'749.28	-9'259.03
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'142'798'567.04</b>	<b>2'379'789'738.54</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse FA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		222'144.632	37'958.533
Ausgegebene Anteile		156'358.023	224'786.177
Zurückgenommene Anteile		-18'616.449	-40'600.078
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>359'886.206</b>	<b>222'144.632</b>
<b>Klasse GA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		25'281.311	197'625.190
Ausgegebene Anteile		14'890.711	86'199.436
Zurückgenommene Anteile		-18'202.286	-258'543.315
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>21'969.736</b>	<b>25'281.311</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		491'972.930	1'420'173.676
Ausgegebene Anteile		241'135.989	489'635.871
Zurückgenommene Anteile		-90'561.736	-1'417'836.617
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>642'547.183</b>	<b>491'972.930</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		24'052'446.723	18'939'354.292
Ausgegebene Anteile		3'281'143.669	5'946'328.455
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		4'815'547.381	3'786'315.801
Zurückgenommene Anteile		-139'332.135	-493'961.175
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-1'054'538.905	-4'125'590.650
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>30'955'266.733</b>	<b>24'052'446.723</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	30.05.2024	107'710'121.62	1'124'785.367
Klasse NT CHF	11.06.2024	68'029'026.73	707'779.724
Klasse NT CHF	04.07.2024	159'478'723.53	1'647'444.504
Klasse NT CHF	18.07.2024	130'311'493.52	1'335'537.786

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	11.06.2024	101'358'166.85	1'054'538.905

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		2'379'789'738.54	1'884'778'958.66
Ausbezahlte Ausschüttung		-296'312.56	-223'859.88
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-10'270'521.08	-5'995'060.05
Saldo aus dem Anteilverkehr		693'119'704.99	384'553'244.30
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		80'455'957.15	116'676'455.51
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>3'142'798'567.04</b>	<b>2'379'789'738.54</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		10'191.14	14'381.25
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		18'346'236.97	26'148'251.19
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		3'217'266.88	5'300'769.09
<b>Total Ertrag</b>		<b>21'573'694.99</b>	<b>31'463'401.53</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-57'059.09	-206'651.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-459'056.09	-4'592'150.90
<b>Total Aufwand</b>		<b>-516'115.18</b>	<b>-4'798'802.05</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>21'057'579.81</b>	<b>26'664'599.48</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'913'179.87	-21'545'862.58
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		1'421'809.53	2'566'900.85
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>18'566'209.47</b>	<b>7'685'637.75</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		61'889'747.68	108'990'817.76
<b>Gesamterfolg</b>		<b>80'455'957.15</b>	<b>116'676'455.51</b>



## 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.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>3'115'178'181.67</b>	<b>99.12</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>3'115'178'181.67</b>	<b>99.12</b>	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	9'000	1'870	0	10'870 CHF	104.05%	11'310'235.00	0.36	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	5'795	0	5'795	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	5'370	1'985	0	7'355 CHF	107.35%	7'895'592.50	0.25	a)
CH0119533278	3.1250 % UBS 3 1/8 11/12/30 EMTN	1'865	285	0	2'150 CHF	109.20%	2'347'800.00	0.07	a)
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	3'260	300	0	3'560 CHF	101.97%	3'630'132.00	0.12	a)
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	2'490	1'300	0	3'790 CHF	109.50%	4'150'050.00	0.13	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42	2'180	200	0	2'380 CHF	113.85%	2'709'630.00	0.09	a)
CH0188335365	1.7500 % SCMN VX 1 3/4 07/10/24	100	0	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	3'100	0	0	3'100 CHF	120.70%	3'741'700.00	0.12	a)
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	150	350	0	500 CHF	108.85%	544'250.00	0.02	a)
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	1'750	270	0	2'020 CHF	121.40%	2'452'280.00	0.08	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26	3'200	450	0	3'650 CHF	102.40%	3'737'600.00	0.12	a)
CH0240672235	2.1250 % SYN NVX 1 1/2 11/01/29	3'610	400	0	4'010 CHF	102.50%	4'110'250.00	0.13	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURN VX 1 1/2 07/22/26	5'905	0	0	5'905 CHF	101.35%	5'984'717.50	0.19	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 07/14/26	5'250	1'300	0	6'550 CHF	100.95%	6'612'225.00	0.21	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	2'065	375	0	2'440 CHF	99.90%	2'437'560.00	0.08	a)
CH0254147504	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 09/28/29	5'200	300	0	5'500 CHF	102.35%	5'629'250.00	0.18	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	3'325	0	3'325	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	1'600	445	0	2'045 CHF	104.65%	2'140'092.50	0.07	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	6'100	600	0	6'700 CHF	99.50%	6'666'500.00	0.21	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	3'250	500	3'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268988182	1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35	4'260	3'400	0	7'660 CHF	97.60%	7'476'160.00	0.24	a)
CH0269382088	0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30	3'050	600	0	3'650 CHF	97.60%	3'562'400.00	0.11	a)
CH0270190983	0.2500 % NOV NVX 0 1/4 05/13/25	11'210	600	11'810	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOV NVX 0 5/8 11/13/29	9'410	2'200	0	11'610 CHF	98.20%	11'401'020.00	0.36	a)
CH0270191007	1.0500 % NOV NVX 1.05 05/11/35	8'300	2'300	0	10'600 CHF	99.50%	10'547'000.00	0.34	a)
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	7'170	1'330	0	8'500 CHF	98.75%	8'393'750.00	0.27	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	1'550	290	0	1'840 CHF	99.96%	1'839'264.00	0.06	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279135328	0.8750 % SGS NVX 0 7/8 05/08/30	4'090	1'300	0	5'390 CHF	99.15%	5'344'185.00	0.17	a)
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	3'650	450	0	4'100 CHF	98.65%	4'044'650.00	0.13	a)
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	3'650	0	0	3'650 CHF	100.00%	3'650'000.00	0.12	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	6'720	1'260	3'000	4'980 CHF	99.63%	4'961'574.00	0.16	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	10'100	1'165	0	11'265 CHF	99.60%	11'219'940.00	0.36	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	2'350	300	0	2'650 CHF	100.82%	2'671'730.00	0.09	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	10'300	1'245	0	11'545 CHF	100.75%	11'631'587.50	0.37	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	2'940	490	0	3'430 CHF	98.98%	3'395'014.00	0.11	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	2'800	480	0	3'280 CHF	100.25%	3'288'200.00	0.10	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	890	0	0	890 CHF	99.90%	889'110.00	0.03	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	4'400	1'200	0	5'600 CHF	100.19%	5'610'640.00	0.18	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	5'050	2'000	7'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0317921663	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 03/31/28	2'000	1'145	0	3'145 CHF	97.90%	3'078'955.00	0.10	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	7'000	500	0	7'500 CHF	98.50%	7'387'500.00	0.24	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	4'630	0	0	4'630 CHF	99.40%	4'602'220.00	0.15	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	0	5'700	0	5'700 CHF	98.90%	5'637'300.00	0.18	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	3'200	295	0	3'495 CHF	98.75%	3'451'312.50	0.11	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	8'120	0	8'120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0320712604	0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31	2'450	500	0	2'950 CHF	96.10%	2'834'950.00	0.09	a)
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	5'350	1'020	0	6'370 CHF	98.55%	6'277'635.00	0.20	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'950	150	0	2'100 CHF	98.75%	2'073'750.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0326213912	0.2500 % KISPZ 0 1/4 07/28/28	3'010	1'200	0	4'210 CHF	95.85%	4'035'285.00	0.13	a)
CH0326213953	0.7500 % KISPZ 0 3/4 07/28/36	1'700	650	0	2'350 CHF	91.30%	2'145'550.00	0.07	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	3'000	300	0	3'300 CHF	99.25%	3'275'250.00	0.10	a)
CH0336352775	0.1250 % SCMNVX 0 1/8 09/15/32	3'150	650	0	3'800 CHF	93.30%	3'545'400.00	0.11	a)
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	2'960	0	2'960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	3'150	285	0	3'435 CHF	95.00%	3'263'250.00	0.10	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	4'300	455	0	4'755 CHF	98.70%	4'693'185.00	0.15	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	3'450	290	0	3'740 CHF	97.05%	3'629'670.00	0.12	a)
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	2'700	0	0	2'700 CHF	97.70%	2'637'900.00	0.08	a)
CH0344583783	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 12/15/27	1'450	750	0	2'200 CHF	97.85%	2'152'700.00	0.07	a)
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	4'000	600	0	4'600 CHF	99.13%	4'559'980.00	0.15	a)
CH0350030422	0.7000 % KWOPER 0.7 01/30/26	900	150	0	1'050 CHF	99.22%	1'041'810.00	0.03	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	7'850	935	0	8'785 CHF	99.01%	8'698'028.50	0.28	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	3'695	800	0	4'495 CHF	99.10%	4'454'545.00	0.14	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNX 0 1/4 09/22/25 EMTN	3'400	600	0	4'000 CHF	99.21%	3'968'400.00	0.13	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	6'200	305	1'000	5'505 CHF	98.95%	5'447'197.50	0.17	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	0	2'250	0	2'250 CHF	98.80%	2'223'000.00	0.07	a)
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	97.50%	2'535'000.00	0.08	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	8'200	0	8'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	3'600	200	0	3'800 CHF	94.10%	3'575'800.00	0.11	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 05/31/27	8'850	650	0	9'500 CHF	98.30%	9'338'500.00	0.30	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	0	10'275	0	10'275 CHF	99.60%	10'233'900.00	0.33	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	4'005	350	0	4'355 CHF	99.60%	4'337'580.00	0.14	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	900	0	0	900 CHF	99.41%	894'690.00	0.03	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	2'740	0	0	2'740 CHF	97.15%	2'661'910.00	0.08	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	4'700	565	0	5'265 CHF	99.20%	5'222'880.00	0.17	a)
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'940	380	0	2'320 CHF	99.60%	2'310'720.00	0.07	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	4'225	400	0	4'625 CHF	99.12%	4'584'300.00	0.15	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 11/24/33	5'400	250	0	5'650 CHF	96.85%	5'472'025.00	0.17	a)
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	0	3'800	0	3'800 CHF	99.00%	3'762'000.00	0.12	a)
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	2'200	0	0	2'200 CHF	99.15%	2'181'300.00	0.07	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	0	5'950	5'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	2'075	750	2'825	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	6'850	850	0	7'700 CHF	97.80%	7'530'600.00	0.24	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	3'800	510	0	4'310 CHF	97.65%	4'208'715.00	0.13	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	0	4'700	0	4'700 CHF	98.35%	4'622'450.00	0.15	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	3'250	400	0	3'650 CHF	98.45%	3'593'425.00	0.11	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	3'250	235	1'000	2'485 CHF	99.27%	2'466'859.50	0.08	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	10'920	1'405	0	12'325 CHF	97.85%	12'060'012.50	0.38	a)
CH0383104343	0.5500 % NESNVX 0.55 10/04/32 EMTN	2'800	770	0	3'570 CHF	96.45%	3'443'265.00	0.11	a)
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125123	0.4000 % HILTI 0.4 11/08/27	2'600	300	0	2'900 CHF	97.95%	2'840'550.00	0.09	a)
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	6'450	500	0	6'950 CHF	99.49%	6'914'555.00	0.22	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	8'150	770	0	8'920 CHF	98.40%	8'777'280.00	0.28	a)
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	7'200	705	0	7'905 CHF	96.85%	7'655'992.50	0.24	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	3'350	500	0	3'850 CHF	99.09%	3'814'965.00	0.12	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	6'550	400	0	6'950 CHF	98.50%	6'845'750.00	0.22	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	2'900	200	0	3'100 CHF	96.95%	3'005'450.00	0.10	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	2'410	1'000	0	3'410 CHF	98.55%	3'360'555.00	0.11	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	2'550	0	0	2'550 CHF	96.75%	2'467'125.00	0.08	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	3'880	500	0	4'380 CHF	99.44%	4'355'472.00	0.14	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	3'750	250	0	4'000 CHF	100.20%	4'008'000.00	0.13	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	2'800	2'400	0	5'200 CHF	99.80%	5'189'600.00	0.17	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	1'100	0	0	1'100 CHF	98.60%	1'084'600.00	0.03	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNX 0.35 10/22/24 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'800	1'300	0	3'100 CHF	97.70%	3'028'700.00	0.10	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	5'350	545	0	5'895 CHF	97.85%	5'768'257.50	0.18	a)
CH0401956872	0.9560 % GYGR 0.956 09/01/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	98.90%	1'681'300.00	0.05	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	3'150	0	0	3'150 CHF	99.25%	3'126'375.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	2'300	1'200	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	3'800	355	0	4'155 CHF	99.65%	4'140'457.50	0.13	a)
CH0413618353	0.7000 % KSBAAAR 0.75 05/23/28	3'400	500	0	3'900 CHF	97.00%	3'783'000.00	0.12	a)
CH0413618361	1.1000 % KSBAAAR 1.1 05/23/33	3'850	520	0	4'370 CHF	96.30%	4'208'310.00	0.13	a)
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	7'650	695	0	8'345 CHF	99.75%	8'324'137.50	0.26	a)
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	3'125	0	3'125	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	4'395	2'600	2'000	4'995 CHF	99.20%	4'955'040.00	0.16	a)
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040982	0.5000 % SCMNVX 0 1/2 03/15/29	2'400	2'550	0	4'950 CHF	97.75%	4'838'625.00	0.15	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	5'370	0	5'370	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	1'970	250	0	2'220 CHF	98.25%	2'181'150.00	0.07	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	2'850	450	0	3'300 CHF	97.60%	3'220'800.00	0.10	a)
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	2'850	690	0	3'540 CHF	98.25%	3'478'050.00	0.11	a)
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	2'700	610	0	3'310 CHF	97.50%	3'227'250.00	0.10	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	8'375	2'000	0	10'375 CHF	98.15%	10'183'062.50	0.32	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	2'700	300	0	3'000 CHF	97.10%	2'913'000.00	0.09	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	2'750	150	0	2'900 CHF	97.10%	2'815'900.00	0.09	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	1'300	0	0	1'300 CHF	89.90%	1'168'700.00	0.04	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	0	3'700	0	3'700 CHF	95.40%	3'529'800.00	0.11	a)
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	1'200	2'300	0	3'500 CHF	75.85%	2'654'750.00	0.08	a)
CH0419041527	0.0000 % LLBSW 0 09/27/29	800	425	0	1'225 CHF	94.20%	1'153'950.00	0.04	a)
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	2'000	340	0	2'340 CHF	95.25%	2'228'850.00	0.07	a)
CH0419041592	0.0000 % SOONVX 0 10/11/29	1'980	1'000	0	2'980 CHF	94.65%	2'820'570.00	0.09	a)
CH0419041600	0.4000 % SOONVX 0.4 10/11/34	1'460	700	0	2'160 CHF	93.05%	2'009'880.00	0.06	a)
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	3'000	600	0	3'600 CHF	96.90%	3'488'400.00	0.11	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	3'050	300	0	3'350 CHF	97.60%	3'269'600.00	0.10	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	1'600	500	0	2'100 CHF	99.30%	2'085'300.00	0.07	a)
CH0419042491	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	11'100	1'800	0	12'900 CHF	99.05%	12'777'450.00	0.41	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	7'045	1'245	0	8'290 CHF	98.45%	8'161'505.00	0.26	a)
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	1'600	350	0	1'950 CHF	99.93%	1'948'635.00	0.06	a)
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	1'550	455	0	2'005 CHF	100.30%	2'011'015.00	0.06	a)
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	4'900	395	0	5'295 CHF	98.80%	5'231'460.00	0.17	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	3'650	1'200	0	4'850 CHF	99.45%	4'823'325.00	0.15	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	6'100	0	6'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	6'450	300	0	6'750 CHF	99.63%	6'725'025.00	0.21	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	4'300	0	0	4'300 CHF	98.80%	4'248'400.00	0.14	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	2'200	250	0	2'450 CHF	99.70%	2'442'650.00	0.08	a)
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	4'050	615	0	4'665 CHF	99.73%	4'652'404.50	0.15	a)
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	4'100	1'100	0	5'200 CHF	99.25%	5'161'000.00	0.16	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	0	6'300	0	6'300 CHF	98.10%	6'180'300.00	0.20	a)
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	3'400	200	0	3'600 CHF	95.00%	3'420'000.00	0.11	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	4'800	800	0	5'600 CHF	99.19%	5'554'640.00	0.18	a)
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	2'700	800	0	3'500 CHF	96.85%	3'389'750.00	0.11	a)
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	4'200	300	0	4'500 CHF	96.95%	4'362'750.00	0.14	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	2'100	810	0	2'910 CHF	95.30%	2'773'230.00	0.09	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	4'780	605	0	5'385 CHF	96.00%	5'169'600.00	0.16	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	3'350	1'000	0	4'350 CHF	96.00%	4'176'000.00	0.13	a)
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	2'810	800	0	3'610 CHF	92.90%	3'353'690.00	0.11	a)
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	6'200	1'385	0	7'585 CHF	98.85%	7'497'772.50	0.24	a)
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	1'600	400	0	2'000 CHF	99.72%	1'994'400.00	0.06	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	6'200	305	0	6'505 CHF	99.50%	6'472'475.00	0.21	a)
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	4'200	0	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	2'150	555	1'000	1'705 CHF	99.24%	1'692'042.00	0.05	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	2'280	600	0	2'880 CHF	99.45%	2'864'160.00	0.09	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	1'060	0	0	1'060 CHF	99.65%	1'056'290.00	0.03	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	8'160	3'150	11'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	0	2'500	0	2'500 CHF	99.35%	2'483'750.00	0.08	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'250	480	0	1'730 CHF	98.85%	1'710'105.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	3'050	0	2'050	1'000 CHF	99.12%	991'200.00	0.03	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	2'500	550	0	3'050 CHF	98.40%	3'001'200.00	0.10	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	6'050	700	0	6'750 CHF	95.95%	6'476'625.00	0.21	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	2'950	240	0	3'190 CHF	94.20%	3'004'980.00	0.10	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	3'800	600	0	4'400 CHF	96.85%	4'261'400.00	0.14	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	2'680	1'800	0	4'480 CHF	99.26%	4'446'848.00	0.14	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	3'450	450	0	3'900 CHF	96.00%	3'744'000.00	0.12	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'900	395	0	3'295 CHF	97.75%	3'220'862.50	0.10	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	2'000	1'150	1'200	1'950 CHF	95.70%	1'866'150.00	0.06	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	400	700	0	1'100 CHF	99.45%	1'093'950.00	0.03	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	7'550	815	0	8'365 CHF	98.94%	8'276'331.00	0.26	a)
CH0483180961	0.6250 % ORAFP 0 5/8 06/22/29 EMTN	1'695	290	0	1'985 CHF	97.50%	1'935'375.00	0.06	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	1'700	300	0	2'000 CHF	95.95%	1'919'000.00	0.06	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	2'530	1'500	0	4'030 CHF	97.50%	3'929'250.00	0.13	a)
CH0488506665	0.0000 % PSPNSW 0 02/06/30	1'300	770	0	2'070 CHF	93.15%	1'928'205.00	0.06	a)
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	4'500	1'100	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734335	0.0000 % SCMNFX 0 08/30/44	2'400	1'000	0	3'400 CHF	75.50%	2'567'000.00	0.08	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	500	0	0	500 CHF	98.32%	491'600.00	0.02	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	500	355	0	855 CHF	93.55%	799'852.50	0.03	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	6'300	735	0	7'035 CHF	97.70%	6'873'195.00	0.22	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	3'000	400	0	3'400 CHF	97.65%	3'320'100.00	0.11	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	1'850	890	0	2'740 CHF	95.50%	2'616'700.00	0.08	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	3'500	250	0	3'750 CHF	97.75%	3'665'625.00	0.12	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	4'100	400	0	4'500 CHF	98.75%	4'443'750.00	0.14	a)
CH0503144393	0.2500 % BFCM 0 1/4 10/24/29 EMTN	2'500	250	0	2'750 CHF	94.65%	2'602'875.00	0.08	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	6'455	855	0	7'310 CHF	97.05%	7'094'355.00	0.23	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	3'700	555	0	4'255 CHF	97.00%	4'127'350.00	0.13	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	3'600	600	0	4'200 CHF	95.60%	4'015'200.00	0.13	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	6'040	600	0	6'640 CHF	96.05%	6'377'720.00	0.20	a)
CH0506071361	0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31	2'165	0	0	2'165 CHF	92.90%	2'011'285.00	0.06	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	3'430	290	0	3'720 CHF	96.55%	3'591'660.00	0.11	a)
CH0508785745	1.5000 % TEMNSW 1 1/2 11/28/25	0	1'000	0	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.03	a)
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	5'300	200	0	5'500 CHF	94.65%	5'205'750.00	0.17	a)
CH0515152467	0.1300 % SCMNFX 0.13 09/18/31	4'550	0	0	4'550 CHF	93.95%	4'274'725.00	0.14	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	2'000	0	0	2'000 CHF	91.45%	1'829'000.00	0.06	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	1'600	0	0	1'600 CHF	95.15%	1'522'400.00	0.05	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	3'200	315	0	3'515 CHF	96.00%	3'374'400.00	0.11	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	2'750	400	0	3'150 CHF	95.60%	3'011'400.00	0.10	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	2'670	0	2'670	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	4'460	340	0	4'800 CHF	95.80%	4'598'400.00	0.15	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	4'400	400	0	4'800 CHF	98.64%	4'734'720.00	0.15	a)
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	3'200	400	0	3'600 CHF	96.85%	3'486'600.00	0.11	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	2'400	800	0	3'200 CHF	95.50%	3'056'000.00	0.10	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	8'700	2'000	800	9'900 CHF	92.45%	9'152'550.00	0.29	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	3'800	355	0	4'155 CHF	98.05%	4'073'977.50	0.13	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	4'600	400	0	5'000 CHF	97.65%	4'882'500.00	0.16	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	4'150	300	0	4'450 CHF	91.85%	4'087'325.00	0.13	a)
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	2'680	150	0	2'830 CHF	98.30%	2'781'890.00	0.09	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	7'550	580	0	8'130 CHF	99.60%	8'097'480.00	0.26	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	2'750	1'845	0	4'595 CHF	99.20%	4'558'240.00	0.15	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	3'650	1'900	0	5'550 CHF	98.10%	5'444'550.00	0.17	a)
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	3'000	250	0	3'250 CHF	92.65%	3'011'125.00	0.10	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	4'900	0	4'900 CHF	97.15%	4'760'350.00	0.15	a)
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	1'300	650	0	1'950 CHF	90.55%	1'765'725.00	0.06	a)
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	4'250	3'000	7'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	4'650	250	0	4'900 CHF	99.80%	4'890'200.00	0.16	a)
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	0	4'350	0	4'350 CHF	100.00%	4'350'000.00	0.14	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	2'840	1'050	0	3'890 CHF	98.30%	3'823'870.00	0.12	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	3'150	250	0	3'400 CHF	99.21%	3'373'140.00	0.11	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	4'250	350	0	4'600 CHF	99.35%	4'570'100.00	0.15	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	6'210	200	0	6'410 CHF	98.35%	6'304'235.00	0.20	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	2'800	600	0	3'400 CHF	98.05%	3'333'700.00	0.11	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	2'900	200	0	3'100 CHF	99.27%	3'077'370.00	0.10	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	6'190	400	0	6'590 CHF	99.70%	6'570'230.00	0.21	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	1'620	200	0	1'820 CHF	98.00%	1'783'600.00	0.06	a)
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	5'250	425	0	5'675 CHF	97.30%	5'521'775.00	0.18	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	5'550	2'020	0	7'570 CHF	95.75%	7'248'275.00	0.23	a)
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	3'300	0	0	3'300 CHF	99.14%	3'271'620.00	0.10	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	3'550	370	0	3'920 CHF	96.20%	3'771'040.00	0.12	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	1'990	250	0	2'240 CHF	98.30%	2'201'920.00	0.07	a)
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	3'300	2'250	0	5'550 CHF	96.00%	5'328'000.00	0.17	a)
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	4'350	1'250	0	5'600 CHF	93.50%	5'236'000.00	0.17	a)
CH0570576279	0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36	2'300	0	0	2'300 CHF	88.10%	2'026'300.00	0.06	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	1'110	0	0	1'110 CHF	96.25%	1'068'375.00	0.03	a)
CH0572899091	0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25	0	2'400	1'000	1'400 CHF	99.41%	1'391'740.00	0.04	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	4'400	500	0	4'900 CHF	96.35%	4'721'150.00	0.15	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	2'000	350	0	2'350 CHF	98.00%	2'303'000.00	0.07	a)
CH0580291968	0.2450 % SCMNVX 0.245 11/20/34	2'500	550	0	3'050 CHF	91.55%	2'792'275.00	0.09	a)
CH0580464698	1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34	2'300	700	0	3'000 CHF	98.30%	2'949'000.00	0.09	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	6'350	1'000	7'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	6'150	3'935	0	10'085 CHF	88.65%	8'940'352.50	0.28	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	7'750	0	7'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	2'900	800	0	3'700 CHF	97.55%	3'609'350.00	0.11	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	4'600	1'900	0	6'500 CHF	93.90%	6'103'500.00	0.19	a)
CH0593093211	0.1250 % KWOPER 0 1/8 02/21/31	2'340	1'400	0	3'740 CHF	93.20%	3'485'680.00	0.11	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	3'600	1'400	0	5'000 CHF	95.75%	4'787'500.00	0.15	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	3'740	1'300	0	5'040 CHF	97.10%	4'893'840.00	0.16	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	4'400	0	1'000	3'400 CHF	97.20%	3'304'800.00	0.11	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	2'000	1'240	0	3'240 CHF	92.45%	2'995'380.00	0.10	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	7'400	800	0	8'200 CHF	94.85%	7'777'700.00	0.25	a)
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	3'400	295	0	3'695 CHF	93.75%	3'464'062.50	0.11	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	2'550	360	0	2'910 CHF	93.15%	2'710'665.00	0.09	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	6'400	605	0	7'005 CHF	95.75%	6'707'287.50	0.21	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	1'040	2'000	0	3'040 CHF	97.25%	2'956'400.00	0.09	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	2'960	0	0	2'960 CHF	97.85%	2'896'360.00	0.09	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	4'600	0	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	8'755	0	8'755 CHF	96.35%	8'435'442.50	0.27	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	0	4'800	0	4'800 CHF	95.20%	4'569'600.00	0.15	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	0	4'340	0	4'340 CHF	96.50%	4'188'100.00	0.13	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	2'040	150	0	2'190 CHF	98.30%	2'152'770.00	0.07	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	3'800	450	0	4'250 CHF	95.85%	4'073'625.00	0.13	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	6'450	250	0	6'700 CHF	96.00%	6'432'000.00	0.20	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	0	800	0	800 CHF	98.50%	788'000.00	0.03	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	8'990	945	0	9'935 CHF	96.95%	9'631'982.50	0.31	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	7'400	1'120	0	8'520 CHF	96.75%	8'243'100.00	0.26	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	3'100	1'050	0	4'150 CHF	96.30%	3'996'450.00	0.13	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	5'000	200	0	5'200 CHF	97.90%	5'090'800.00	0.16	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	3'150	340	0	3'490 CHF	96.75%	3'376'575.00	0.11	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33	250	585	0	835 CHF	93.15%	777'802.50	0.02	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	7'200	600	0	7'800 CHF	97.15%	7'577'700.00	0.24	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	7'050	300	0	7'350 CHF	95.20%	6'997'200.00	0.22	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	0	6'170	0	6'170 CHF	95.10%	5'867'670.00	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.
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	2'800	2'000	0	4'800 CHF	96.00%	4'608'000.00	0.15	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'690	650	0	2'340 CHF	92.35%	2'160'990.00	0.07	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	2'560	1'550	0	4'110 CHF	90.00%	3'699'000.00	0.12	a)
CH1118223499	0.3000 % KSSTGA 0.3 09/30/36	2'170	300	0	2'470 CHF	85.00%	2'099'500.00	0.07	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	3'650	2'300	0	5'950 CHF	92.55%	5'506'725.00	0.18	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	2'850	920	0	3'770 CHF	95.00%	3'581'500.00	0.11	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	2'550	270	0	2'820 CHF	96.00%	2'707'200.00	0.09	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	6'700	630	0	7'330 CHF	96.50%	7'073'450.00	0.23	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	4'600	1'650	0	6'250 CHF	96.40%	6'025'000.00	0.19	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	5'450	515	0	5'965 CHF	97.30%	5'803'945.00	0.18	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	5'590	700	0	6'290 CHF	94.45%	5'940'905.00	0.19	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	5'250	645	0	5'895 CHF	93.75%	5'526'562.50	0.18	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	5'600	200	0	5'800 CHF	97.05%	5'628'900.00	0.18	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	50	0	0	50 CHF	96.65%	48'325.00	0.00	a)
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	2'900	0	0	2'900 CHF	94.10%	2'728'900.00	0.09	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	750	150	0	900 CHF	93.75%	843'750.00	0.03	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	5'250	1'430	0	6'680 CHF	95.05%	6'349'340.00	0.20	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	2'250	0	0	2'250 CHF	90.60%	2'038'500.00	0.06	a)
CH1129053828	0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40	1'600	170	0	1'770 CHF	85.40%	1'511'580.00	0.05	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	3'900	200	0	4'100 CHF	98.92%	4'055'720.00	0.13	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'130	0	0	1'130 CHF	98.40%	1'111'920.00	0.04	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	1'935	1'000	0	2'935 CHF	84.80%	2'488'880.00	0.08	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	2'950	1'525	0	4'475 CHF	98.10%	4'389'975.00	0.14	a)
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	3'405	0	0	3'405 CHF	92.10%	3'136'005.00	0.10	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	1'755	300	0	2'055 CHF	91.40%	1'878'270.00	0.06	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	2'390	700	0	3'090 CHF	94.65%	2'924'685.00	0.09	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	2'200	200	0	2'400 CHF	95.15%	2'283'600.00	0.07	a)
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	3'050	460	0	3'510 CHF	93.05%	3'266'055.00	0.10	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	6'600	1'245	0	7'845 CHF	94.60%	7'421'370.00	0.24	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	3'890	1'700	0	5'590 CHF	93.35%	5'218'265.00	0.17	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	4'400	400	0	4'800 CHF	97.00%	4'656'000.00	0.15	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	95.95%	3'454'200.00	0.11	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	3'900	1'300	0	5'200 CHF	94.80%	4'929'600.00	0.16	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	5'130	400	0	5'530 CHF	98.67%	5'456'451.00	0.17	a)
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	2'550	485	0	3'035 CHF	94.85%	2'878'697.50	0.09	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	4'950	1'745	0	6'695 CHF	94.60%	6'333'470.00	0.20	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	2'200	1'245	0	3'445 CHF	96.45%	3'322'702.50	0.11	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	3'400	375	500	3'275 CHF	97.15%	3'181'662.50	0.10	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	5'850	610	0	6'460 CHF	95.30%	6'156'380.00	0.20	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	3'700	665	0	4'365 CHF	95.60%	4'172'940.00	0.13	a)
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	2'340	430	0	2'770 CHF	98.20%	2'720'140.00	0.09	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	2'200	150	0	2'350 CHF	97.15%	2'283'025.00	0.07	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	5'420	1'435	0	6'855 CHF	96.30%	6'601'365.00	0.21	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	7'930	650	0	8'580 CHF	97.50%	8'365'500.00	0.27	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	5'400	1'600	0	7'000 CHF	96.70%	6'769'000.00	0.22	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	4'000	600	0	4'600 CHF	106.35%	4'892'100.00	0.16	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	3'950	310	0	4'260 CHF	97.65%	4'159'890.00	0.13	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	3'250	360	0	3'610 CHF	96.20%	3'472'820.00	0.11	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	8'310	880	0	9'190 CHF	96.10%	8'831'590.00	0.28	a)
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	4'460	250	0	4'710 CHF	97.80%	4'606'380.00	0.15	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	6'800	800	0	7'600 CHF	97.30%	7'394'800.00	0.24	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	6'200	400	0	6'600 CHF	94.25%	6'220'500.00	0.20	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	9'000	2'600	0	11'600 CHF	96.75%	11'223'000.00	0.36	a)
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	2'275	2'250	0	4'525 CHF	94.65%	4'282'912.50	0.14	a)
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	5'750	550	0	6'300 CHF	96.20%	6'060'600.00	0.19	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	950	320	0	1'270 CHF	95.95%	1'218'565.00	0.04	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	3'900	575	0	4'475 CHF	96.45%	4'316'137.50	0.14	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	5'020	500	0	5'520 CHF	97.40%	5'376'480.00	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.
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	3'265	1'500	0	4'765 CHF	96.35%	4'591'077.50	0.15	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	5'600	1'450	0	7'050 CHF	95.60%	6'739'800.00	0.21	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	1'600	850	0	2'450 CHF	96.45%	2'363'025.00	0.08	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	7'200	690	0	7'890 CHF	97.85%	7'720'365.00	0.25	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	1'250	1'330	0	2'580 CHF	95.50%	2'463'900.00	0.08	a)
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 0 1/19/32	1'300	0	0	1'300 CHF	96.95%	1'260'350.00	0.04	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	3'600	1'400	0	5'000 CHF	96.45%	4'822'500.00	0.15	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	2'650	405	0	3'055 CHF	97.90%	2'990'845.00	0.10	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	2'800	600	0	3'400 CHF	96.15%	3'269'100.00	0.10	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	3'200	495	0	3'695 CHF	97.50%	3'602'625.00	0.11	a)
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	2'050	1'690	0	3'740 CHF	96.65%	3'614'710.00	0.12	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	5'800	0	0	5'800 CHF	98.35%	5'704'300.00	0.18	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	950	0	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	4'250	595	0	4'845 CHF	99.70%	4'830'465.00	0.15	a)
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	0	275	275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	2'600	400	0	3'000 CHF	98.70%	2'961'000.00	0.09	a)
CH1164800661	0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29	1'550	750	0	2'300 CHF	96.85%	2'227'550.00	0.07	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	5'800	3'000	8'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	9'750	900	0	10'650 CHF	99.20%	10'564'800.00	0.34	a)
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	1'220	0	0	1'220 CHF	99.20%	1'210'240.00	0.04	a)
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	8'600	1'365	2'000	7'965 CHF	100.05%	7'968'982.50	0.25	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	4'800	500	0	5'300 CHF	100.50%	5'326'500.00	0.17	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'700	300	0	2'000 CHF	100.10%	2'002'000.00	0.06	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	5'450	0	5'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	3'500	415	0	3'915 CHF	100.10%	3'918'915.00	0.12	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	3'100	1'450	0	4'550 CHF	99.65%	4'534'075.00	0.14	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	1'700	500	0	2'200 CHF	99.50%	2'189'000.00	0.07	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	3'720	0	0	3'720 CHF	99.80%	3'712'560.00	0.12	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	6'750	1'300	0	8'050 CHF	100.90%	8'122'450.00	0.26	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	0	5'000	0	5'000 CHF	101.50%	5'075'000.00	0.16	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	3'500	500	0	4'000 CHF	100.80%	4'032'000.00	0.13	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	4'800	600	0	5'400 CHF	99.75%	5'386'500.00	0.17	a)
CH1182086848	1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37	5'050	200	0	5'250 CHF	99.25%	5'210'625.00	0.17	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	6'700	2'840	0	9'540 CHF	100.40%	9'578'160.00	0.30	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	4'110	0	4'110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	5'700	695	2'000	4'395 CHF	100.00%	4'395'000.00	0.14	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	4'150	0	4'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	4'950	200	4'000	1'150 CHF	100.20%	1'152'300.00	0.04	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	3'500	350	0	3'850 CHF	100.85%	3'882'725.00	0.12	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	3'500	1'455	0	4'955 CHF	100.90%	4'999'595.00	0.16	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	3'300	485	0	3'785 CHF	100.60%	3'807'710.00	0.12	a)
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	2'400	360	0	2'760 CHF	101.30%	2'795'880.00	0.09	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	100.20%	3'206'400.00	0.10	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	4'900	250	0	5'150 CHF	99.90%	5'144'850.00	0.16	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	4'150	0	0	4'150 CHF	99.81%	4'142'115.00	0.13	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	3'490	300	0	3'790 CHF	100.50%	3'808'950.00	0.12	a)
CH1189217768	1.7000 % KTSPL 1.7 06/24/32	2'000	1'200	0	3'200 CHF	101.30%	3'241'600.00	0.10	a)
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	3'400	1'200	0	4'600 CHF	100.25%	4'611'500.00	0.15	a)
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	2'300	270	0	2'570 CHF	101.35%	2'604'695.00	0.08	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	5'400	550	0	5'950 CHF	102.50%	6'098'750.00	0.19	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	2'655	250	0	2'905 CHF	100.06%	2'906'743.00	0.09	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	10'880	1'500	0	12'380 CHF	102.35%	12'670'930.00	0.40	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	4'605	0	0	4'605 CHF	101.90%	4'692'495.00	0.15	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	3'170	300	0	3'470 CHF	100.25%	3'478'675.00	0.11	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	4'800	1'300	0	6'100 CHF	102.40%	6'246'400.00	0.20	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	4'400	200	0	4'600 CHF	101.45%	4'666'700.00	0.15	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	4'550	0	4'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	3'450	1'000	4'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	11'600	1'305	0	12'905 CHF	101.15%	13'053'407.50	0.42	a)
CH1194355116	2.1250 % NESNVX 2 1/8 07/15/30	11'795	2'620	0	14'415 CHF	106.45%	15'344'767.50	0.49	a)
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	7'800	2'055	0	9'855 CHF	112.60%	11'096'730.00	0.35	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	2'790	1'900	0	4'690 CHF	101.45%	4'758'005.00	0.15	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	1'800	200	0	2'000 CHF	115.80%	2'316'000.00	0.07	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	4'600	2'000	0	6'600 CHF	106.10%	7'002'600.00	0.22	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	6'450	1'135	0	7'585 CHF	102.10%	7'744'285.00	0.25	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	7'550	700	0	8'250 CHF	101.45%	8'369'625.00	0.27	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	4'450	595	0	5'045 CHF	104.75%	5'284'637.50	0.17	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	6'500	1'200	0	7'700 CHF	107.00%	8'239'000.00	0.26	a)
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	4'100	1'000	0	5'100 CHF	100.90%	5'145'900.00	0.16	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	4'335	250	0	4'585 CHF	103.35%	4'738'597.50	0.15	a)
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	2'350	150	0	2'500 CHF	102.10%	2'552'500.00	0.08	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	2'400	150	0	2'550 CHF	101.95%	2'599'725.00	0.08	a)
CH1206367471	2.5500 % GROUPE 2.55 09/30/32	2'280	700	0	2'980 CHF	108.40%	3'230'320.00	0.10	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	5'600	1'380	0	6'980 CHF	105.65%	7'374'370.00	0.23	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'150	3'600	0	5'750 CHF	104.45%	6'005'875.00	0.19	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	6'860	735	0	7'595 CHF	103.45%	7'857'027.50	0.25	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	3'100	600	0	3'700 CHF	104.30%	3'859'100.00	0.12	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	2'800	600	0	3'400 CHF	104.50%	3'553'000.00	0.11	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	3'450	350	0	3'800 CHF	101.08%	3'841'040.00	0.12	a)
CH1214797198	2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30	2'650	0	0	2'650 CHF	106.30%	2'816'950.00	0.09	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	5'980	1'200	0	7'180 CHF	103.30%	7'416'940.00	0.24	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	3'700	250	0	3'950 CHF	104.95%	4'145'525.00	0.13	a)
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	2'500	300	0	2'800 CHF	103.70%	2'903'600.00	0.09	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	3'000	0	0	3'000 CHF	101.87%	3'056'100.00	0.10	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	1'630	300	0	1'930 CHF	103.05%	1'988'865.00	0.06	a)
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	4'950	2'230	0	7'180 CHF	100.68%	7'228'824.00	0.23	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	2'280	1'000	0	3'280 CHF	103.00%	3'378'400.00	0.11	a)
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	6'150	1'200	0	7'350 CHF	106.15%	7'802'025.00	0.25	a)
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	5'550	1'800	0	7'350 CHF	115.15%	8'463'525.00	0.27	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	4'150	300	0	4'450 CHF	100.94%	4'491'830.00	0.14	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	7'800	690	0	8'490 CHF	104.95%	8'910'255.00	0.28	a)
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	3'550	680	0	4'230 CHF	100.84%	4'265'532.00	0.14	a)
CH1227937708	2.5025 % EOANGR 2.5025 12/05/29 EMTN	2'500	600	0	3'100 CHF	106.30%	3'295'300.00	0.10	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	6'800	800	0	7'600 CHF	103.45%	7'862'200.00	0.25	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	4'600	400	0	5'000 CHF	101.50%	5'075'000.00	0.16	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	5'800	800	0	6'600 CHF	101.50%	6'699'000.00	0.21	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	4'300	300	0	4'600 CHF	101.59%	4'673'140.00	0.15	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	3'500	1'100	0	4'600 CHF	105.40%	4'848'400.00	0.15	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	3'400	525	700	3'225 CHF	117.65%	3'794'212.50	0.12	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	5'400	250	0	5'650 CHF	102.08%	5'767'520.00	0.18	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	4'680	1'150	0	5'830 CHF	104.25%	6'077'775.00	0.19	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	4'100	480	0	4'580 CHF	103.80%	4'754'040.00	0.15	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	4'550	1'050	0	5'600 CHF	100.85%	5'647'600.00	0.18	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	103.05%	2'679'300.00	0.09	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	4'600	400	0	5'000 CHF	104.75%	5'237'500.00	0.17	a)
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	2'600	1'550	0	4'150 CHF	102.75%	4'264'125.00	0.14	a)
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	2'900	400	0	3'300 CHF	101.25%	3'341'250.00	0.11	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	3'000	400	0	3'400 CHF	103.20%	3'508'800.00	0.11	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	3'760	350	0	4'110 CHF	101.31%	4'163'841.00	0.13	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	4'150	0	4'150 CHF	106.05%	4'401'075.00	0.14	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	8'500	600	0	9'100 CHF	103.90%	9'454'900.00	0.30	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	2'680	2'000	0	4'680 CHF	105.35%	4'930'380.00	0.16	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	3'700	1'150	0	4'850 CHF	103.80%	5'034'300.00	0.16	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	2'065	970	0	3'035 CHF	105.10%	3'189'785.00	0.10	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	4'950	1'055	0	6'005 CHF	104.20%	6'257'210.00	0.20	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.
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	4'400	1'000	0	5'400 CHF	109.25%	5'899'500.00	0.19	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	4'600	560	0	5'160 CHF	102.65%	5'296'740.00	0.17	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	5'400	200	0	5'600 CHF	101.75%	5'698'000.00	0.18	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	3'700	975	0	4'675 CHF	104.10%	4'866'675.00	0.15	a)
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	3'600	565	0	4'165 CHF	101.12%	4'211'648.00	0.13	a)
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	3'450	250	0	3'700 CHF	103.95%	3'846'150.00	0.12	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	3'000	300	0	3'300 CHF	103.90%	3'428'700.00	0.11	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLILI 2.35 03/01/27	3'700	600	0	4'300 CHF	102.30%	4'398'900.00	0.14	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLILI 2 3/4 03/01/30	4'350	650	0	5'000 CHF	107.35%	5'367'500.00	0.17	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	9'960	2'595	0	12'555 CHF	103.05%	12'937'927.50	0.41	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	4'500	665	0	5'165 CHF	102.90%	5'314'785.00	0.17	a)
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	1'200	250	0	1'450 CHF	105.50%	1'529'750.00	0.05	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	5'400	600	0	6'000 CHF	105.55%	6'333'000.00	0.20	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	4'200	600	0	4'800 CHF	105.65%	5'071'200.00	0.16	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	2'850	400	0	3'250 CHF	101.95%	3'313'375.00	0.11	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	3'800	2'155	0	5'955 CHF	105.30%	6'270'615.00	0.20	a)
CH1244731753	2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTM	3'000	1'000	0	4'000 CHF	104.60%	4'184'000.00	0.13	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	101.38%	4'055'200.00	0.13	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	4'700	300	0	5'000 CHF	103.70%	5'185'000.00	0.16	a)
CH1248666930	1.8750 % SCMNVS 1 7/8 08/23/30	3'520	1'625	0	5'145 CHF	104.45%	5'373'952.50	0.17	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	3'300	300	0	3'600 CHF	101.48%	3'653'280.00	0.12	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	5'400	1'255	0	6'655 CHF	106.00%	7'054'300.00	0.22	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	900	700	0	1'600 CHF	106.55%	1'704'800.00	0.05	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	3'200	200	0	3'400 CHF	103.90%	3'532'600.00	0.11	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	6'340	565	0	6'905 CHF	101.13%	6'983'026.50	0.22	a)
CH1249416087	2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32	6'270	2'050	0	8'320 CHF	108.60%	9'035'520.00	0.29	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	7'200	800	0	8'000 CHF	103.90%	8'312'000.00	0.26	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	5'100	580	0	5'680 CHF	105.15%	5'972'520.00	0.19	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	4'750	0	4'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	3'355	0	3'355 CHF	105.25%	3'531'137.50	0.11	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	4'200	1'050	0	5'250 CHF	101.70%	5'339'250.00	0.17	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	3'650	1'455	0	5'105 CHF	104.45%	5'332'172.50	0.17	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	2'530	625	0	3'155 CHF	104.15%	3'285'932.50	0.10	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	5'380	545	0	5'925 CHF	102.90%	6'096'825.00	0.19	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	5'110	1'050	0	6'160 CHF	108.65%	6'692'840.00	0.21	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	5'175	1'600	0	6'775 CHF	105.25%	7'130'687.50	0.23	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	6'000	1'250	0	7'250 CHF	103.50%	7'503'750.00	0.24	a)
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	2'000	200	0	2'200 CHF	105.10%	2'312'200.00	0.07	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	3'600	400	0	4'000 CHF	102.50%	4'100'000.00	0.13	a)
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	2'500	300	0	2'800 CHF	107.20%	3'001'600.00	0.10	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	9'600	1'090	0	10'690 CHF	102.85%	10'994'665.00	0.35	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	5'600	0	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	3'500	1'100	0	4'600 CHF	105.45%	4'850'700.00	0.15	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	6'000	800	0	6'800 CHF	104.45%	7'102'600.00	0.23	a)
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	2'480	250	0	2'730 CHF	103.40%	2'822'820.00	0.09	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	3'200	250	0	3'450 CHF	102.45%	3'534'525.00	0.11	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	3'250	600	0	3'850 CHF	101.75%	3'917'375.00	0.12	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	3'440	350	0	3'790 CHF	110.55%	4'189'845.00	0.13	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	4'705	2'200	0	6'905 CHF	105.85%	7'308'942.50	0.23	a)
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	4'575	880	0	5'455 CHF	101.50%	5'536'825.00	0.18	a)
CH1266847172	2.4000 % KENOVA 2.4 07/19/38	1'675	0	0	1'675 CHF	113.00%	1'892'750.00	0.06	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	4'800	550	0	5'350 CHF	102.10%	5'462'350.00	0.17	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	4'950	1'500	0	6'450 CHF	106.20%	6'849'900.00	0.22	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	3'100	100	0	3'200 CHF	106.85%	3'419'200.00	0.11	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	5'000	600	0	5'600 CHF	105.45%	5'905'200.00	0.19	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	2'700	1'000	0	3'700 CHF	103.00%	3'811'000.00	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1271007952	2.3750 % HYNOE 2 3/8 01/26/29 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	3'800	400	0	4'200 CHF	105.00%	4'410'000.00	0.14	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	6'225	0	6'225 CHF	105.15%	6'545'587.50	0.21	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	1'990	0	0	1'990 CHF	101.12%	2'012'288.00	0.06	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	4'900	585	0	5'485 CHF	101.13%	5'546'980.50	0.18	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	2'800	400	0	3'200 CHF	102.45%	3'278'400.00	0.10	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	6'260	550	0	6'810 CHF	104.00%	7'082'400.00	0.23	a)
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	9'600	1'145	0	10'745 CHF	107.50%	11'550'875.00	0.37	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	8'910	2'660	1'800	9'770 CHF	111.50%	10'893'550.00	0.35	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	4'200	0	2'000	2'200 CHF	101.05%	2'223'100.00	0.07	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	2'040	780	0	2'820 CHF	103.95%	2'931'390.00	0.09	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	5'000	600	0	5'600 CHF	104.60%	5'857'600.00	0.19	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	5'270	930	0	6'200 CHF	107.40%	6'658'800.00	0.21	a)
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	2'365	260	0	2'625 CHF	101.37%	2'660'962.50	0.08	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN	5'500	200	1'500	4'200 CHF	101.32%	4'255'440.00	0.14	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	2'700	865	0	3'565 CHF	105.35%	3'755'727.50	0.12	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	3'500	200	0	3'700 CHF	101.41%	3'752'170.00	0.12	a)
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	3'250	300	0	3'550 CHF	105.30%	3'738'150.00	0.12	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	6'600	1'150	0	7'750 CHF	107.90%	8'362'250.00	0.27	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	3'400	350	0	3'750 CHF	102.35%	3'838'125.00	0.12	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	4'600	585	0	5'185 CHF	106.30%	5'511'655.00	0.18	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	4'400	400	0	4'800 CHF	102.80%	4'934'400.00	0.16	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	3'700	750	0	4'450 CHF	102.00%	4'539'000.00	0.14	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	3'700	700	0	4'400 CHF	105.90%	4'659'600.00	0.15	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	4'400	1'300	0	5'700 CHF	102.95%	5'868'150.00	0.19	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	5'800	2'655	0	8'455 CHF	105.05%	8'881'977.50	0.28	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	3'050	200	0	3'250 CHF	103.25%	3'355'625.00	0.11	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	4'250	1'400	0	5'650 CHF	105.05%	5'935'325.00	0.19	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	3'980	1'990	0	5'970 CHF	106.90%	6'381'930.00	0.20	a)
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	4'030	300	0	4'330 CHF	109.40%	4'737'020.00	0.15	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	3'900	0	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	3'200	1'130	0	4'330 CHF	104.25%	4'514'025.00	0.14	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	5'140	0	0	5'140 CHF	99.40%	5'109'160.00	0.16	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	5'600	600	0	6'200 CHF	102.30%	6'342'600.00	0.20	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	3'700	800	0	4'500 CHF	106.60%	4'797'000.00	0.15	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	5'000	800	0	5'800 CHF	102.50%	5'945'000.00	0.19	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	5'700	800	0	6'500 CHF	106.90%	6'948'500.00	0.22	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	4'330	565	0	4'895 CHF	104.35%	5'107'932.50	0.16	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	2'920	1'050	0	3'970 CHF	108.00%	4'287'600.00	0.14	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	3'050	700	0	3'750 CHF	104.05%	3'901'875.00	0.12	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	8'360	1'705	0	10'065 CHF	101.75%	10'241'137.50	0.33	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	7'360	650	0	8'010 CHF	107.40%	8'602'740.00	0.27	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	4'200	800	0	5'000 CHF	103.50%	5'175'000.00	0.16	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	8'400	1'100	0	9'500 CHF	103.05%	9'789'750.00	0.31	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	7'000	2'395	0	9'395 CHF	105.25%	9'888'237.50	0.31	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	3'900	490	0	4'390 CHF	102.65%	4'506'335.00	0.14	a)
CH1291809916	2.5500 % EDF 2.55 09/12/31 EMTN	2'450	270	0	2'720 CHF	105.60%	2'872'320.00	0.09	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	6'500	700	0	7'200 CHF	101.80%	7'329'600.00	0.23	a)
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	3'000	1'300	0	4'300 CHF	103.50%	4'450'500.00	0.14	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	6'500	1'250	0	7'750 CHF	107.40%	8'323'500.00	0.26	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	2'200	275	0	2'475 CHF	103.20%	2'554'200.00	0.08	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	6'000	1'575	0	7'575 CHF	102.45%	7'760'587.50	0.25	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	4'250	800	0	5'050 CHF	104.10%	5'257'050.00	0.17	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	4'900	700	0	5'600 CHF	107.60%	6'025'600.00	0.19	a)
CH1293714361	2.3750 % INSBER 2 3/8 09/29/31	3'200	1'330	0	4'530 CHF	105.45%	4'776'885.00	0.15	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	3'250	200	800	2'650 CHF	110.45%	2'926'925.00	0.09	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	4'700	315	0	5'015 CHF	103.25%	5'177'987.50	0.16	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	3'100	390	0	3'490 CHF	104.35%	3'641'815.00	0.12	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	2'100	300	0	2'400 CHF	103.75%	2'490'000.00	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.
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	1'800	200	0	2'000 CHF	102.55%	2'051'000.00	0.07	a)
CH1296276160	2.7475 % ACHMEA 2.7475 10/16/30 EMTN	2'200	300	0	2'500 CHF	107.00%	2'675'000.00	0.09	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	5'600	1'300	0	6'900 CHF	105.70%	7'293'300.00	0.23	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	5'000	1'105	0	6'105 CHF	106.20%	6'483'510.00	0.21	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	4'400	0	0	4'400 CHF	101.80%	4'479'200.00	0.14	a)
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	4'250	390	0	4'640 CHF	104.50%	4'848'800.00	0.15	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	1'900	250	0	2'150 CHF	103.00%	2'214'500.00	0.07	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	1'600	435	0	2'035 CHF	101.50%	2'065'525.00	0.07	a)
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	2'605	1'025	0	3'630 CHF	106.00%	3'847'800.00	0.12	a)
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	3'500	700	0	4'200 CHF	102.05%	4'286'100.00	0.14	a)
CH1300277840	1.8750 % NESNVX 1 7/8 11/20/31	4'500	1'050	0	5'550 CHF	105.55%	5'858'025.00	0.19	a)
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	4'100	1'700	0	5'800 CHF	109.00%	6'322'000.00	0.20	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	2'650	900	0	3'550 CHF	102.10%	3'624'550.00	0.12	a)
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	3'615	595	0	4'210 CHF	107.40%	4'521'540.00	0.14	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	3'300	1'000	0	4'300 CHF	103.20%	4'437'600.00	0.14	a)
CH1300277899	2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31	4'800	800	0	5'600 CHF	106.35%	5'955'600.00	0.19	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	5'800	600	0	6'400 CHF	101.90%	6'521'600.00	0.21	a)
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	3'400	465	0	3'865 CHF	104.60%	4'042'790.00	0.13	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	5'500	455	0	5'955 CHF	101.95%	6'071'122.50	0.19	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	5'370	1'300	0	6'670 CHF	107.50%	7'170'250.00	0.23	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	3'050	1'100	0	4'150 CHF	101.15%	4'197'725.00	0.13	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	4'800	385	0	5'185 CHF	102.70%	5'324'995.00	0.17	a)
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	4'000	400	0	4'400 CHF	105.75%	4'653'000.00	0.15	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	3'000	1'350	0	4'350 CHF	101.70%	4'423'950.00	0.14	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLLI 2 1/4 12/05/25	2'000	0	0	2'000 CHF	101.31%	2'026'200.00	0.06	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLLI 2 3/8 12/05/29	1'780	1'000	0	2'780 CHF	105.30%	2'927'340.00	0.09	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	3'900	750	4'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	6'300	2'000	8'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	1'500	0	0	1'500 CHF	101.75%	1'526'250.00	0.05	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	3'500	750	0	4'250 CHF	103.70%	4'407'250.00	0.14	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	5'535	750	0	6'285 CHF	103.10%	6'479'835.00	0.21	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	4'900	200	5'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	2'100	0	2'100 CHF	103.15%	2'166'150.00	0.07	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	6'300	0	6'300 CHF	105.05%	6'618'150.00	0.21	a)
CH1319968579	2.1000 % ALLNSW 2.1 04/04/31	0	3'960	0	3'960 CHF	103.45%	4'096'620.00	0.13	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	10'785	0	10'785 CHF	104.20%	11'237'970.00	0.36	a)
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	3'920	0	3'920 CHF	102.70%	4'025'840.00	0.13	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	6'200	1'350	0	7'550 CHF	104.80%	7'912'400.00	0.25	a)
CH1321481538	2.5000 % MUNHYP 2 1/2 02/20/30 EMTN	3'200	600	0	3'800 CHF	104.45%	3'969'100.00	0.13	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	2'800	1'050	0	3'850 CHF	103.90%	4'000'150.00	0.13	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	4'350	0	4'350 CHF	102.80%	4'471'800.00	0.14	a)
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	9'120	0	9'120 CHF	102.60%	9'357'120.00	0.30	a)
CH1321508363	1.5650 % EDF 1.565 09/06/29 EMTN	0	4'200	0	4'200 CHF	99.94%	4'197'270.00	0.13	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	4'000	410	0	4'410 CHF	103.60%	4'568'760.00	0.15	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	4'780	0	4'780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	5'510	0	5'510	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325037021	1.7000 % DAESW 1.7 10/30/29	0	3'150	0	3'150 CHF	101.75%	3'205'125.00	0.10	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	3'250	0	3'250 CHF	101.35%	3'293'875.00	0.10	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	850	0	850 CHF	104.40%	887'400.00	0.03	a)
CH1325807845	2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30	2'500	200	0	2'700 CHF	102.25%	2'760'750.00	0.09	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	5'400	800	0	6'200 CHF	103.30%	6'404'600.00	0.20	a)
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	5'400	2'705	0	8'105 CHF	105.20%	8'526'460.00	0.27	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	4'900	3'170	0	8'070 CHF	101.70%	8'207'190.00	0.26	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	6'400	3'140	0	9'540 CHF	103.65%	9'888'210.00	0.31	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	4'900	4'990	2'000	7'890 CHF	106.05%	8'367'345.00	0.27	a)
CH1331113501	2.3750 % CLNVX 2 3/8 03/30/27	0	4'835	0	4'835 CHF	102.20%	4'941'370.00	0.16	a)
CH1331113519	2.7500 % CLNVX 2 3/4 03/28/31	0	4'345	0	4'345 CHF	105.90%	4'601'355.00	0.15	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	102.85%	6'171'000.00	0.20	a)
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	6'640	0	6'640 CHF	103.15%	6'849'160.00	0.22	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.
CH1331113576	2.0105 % SWEDA 2.0105 10/10/30	0	2'800	0	2'800 CHF	103.05%	2'885'400.00	0.09	a)
CH1331113634	1.6500 % GALESW 1.65 04/30/31	0	2'450	0	2'450 CHF	101.45%	2'485'525.00	0.08	a)
CH1335850306	2.8000 % UINT 2.8 07/23/27	0	3'300	0	3'300 CHF	101.10%	3'336'300.00	0.11	a)
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	0	820	0	820 CHF	99.94%	819'508.00	0.03	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	5'340	0	5'340 CHF	101.95%	5'444'130.00	0.17	a)
CH1337248962	1.6500 % PSPNSW 1.65 10/11/32	0	2'550	0	2'550 CHF	101.70%	2'593'350.00	0.08	a)
CH1337248988	2.1175 % RAIFFS 2.1175 05/14/32	0	2'100	0	2'100 CHF	103.15%	2'166'150.00	0.07	a)
CH1341034994	1.4100 % SLHNVX 1.41 04/26/27	0	1'800	0	1'800 CHF	100.75%	1'813'500.00	0.06	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNVX 1.5025 04/26/30	0	4'325	0	4'325 CHF	101.45%	4'387'712.50	0.14	a)
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	5'025	0	5'025 CHF	102.45%	5'148'112.50	0.16	a)
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	3'305	0	3'305 CHF	101.60%	3'357'880.00	0.11	a)
CH1344316745	1.3750 % NESNVX 1 3/8 11/30/28	0	4'845	0	4'845 CHF	101.50%	4'917'675.00	0.16	a)
CH1344316752	1.5000 % NESNVX 1 1/2 05/30/31	0	5'400	0	5'400 CHF	102.90%	5'556'600.00	0.18	a)
CH1344316760	1.6250 % NESNVX 1 5/8 05/30/34	0	11'200	0	11'200 CHF	104.25%	11'676'000.00	0.37	a)
CH1344316778	1.7500 % NESNVX 1 3/4 05/30/40	0	8'140	0	8'140 CHF	107.00%	8'709'800.00	0.28	a)
CH1346742856	2.1000 % KSAARA 2.1 05/15/34	0	1'100	0	1'100 CHF	104.60%	1'150'600.00	0.04	a)
CH1346742898	1.6500 % VISECA 1.65 06/06/28	0	4'300	0	4'300 CHF	101.30%	4'355'900.00	0.14	a)
CH1346742930	1.9000 % PGHNSW 1.9 06/07/30	0	4'200	0	4'200 CHF	103.00%	4'326'000.00	0.14	a)
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	0	7'550	0	7'550 CHF	105.10%	7'935'050.00	0.25	a)
CH1346742963	2.1000 % LUZKAN 2.1 06/21/34	0	3'850	0	3'850 CHF	104.90%	4'038'650.00	0.13	a)
CH1346743011	1.8500 % WASSER 1.85 07/01/38	0	2'600	0	2'600 CHF	107.45%	2'793'700.00	0.09	a)
CH1346743029	2.0500 % MOBNSW 2.05 07/01/30	0	3'500	0	3'500 CHF	102.90%	3'601'500.00	0.11	a)
CH1346743060	1.7500 % COOPSW 1 3/4 07/17/28	0	4'800	0	4'800 CHF	102.00%	4'896'000.00	0.16	a)
CH1346743078	1.8500 % COOPSW 1.85 07/16/32	0	6'600	0	6'600 CHF	103.95%	6'860'700.00	0.22	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	5'400	0	5'400 CHF	101.80%	5'497'200.00	0.17	a)
CH1348614046	1.8000 % BARY 1.8 05/15/26	0	4'600	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614053	2.0500 % BARY 2.05 05/17/30	0	5'600	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614061	2.4000 % BARY 2.4 05/17/34	0	4'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	5'345	0	5'345 CHF	102.10%	5'457'245.00	0.17	a)
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	0	5'830	0	5'830 CHF	104.40%	6'086'520.00	0.19	a)
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	8'600	0	8'600 CHF	102.45%	8'810'700.00	0.28	a)
CH1348614160	2.0975 % AGUAND 2.0975 05/30/29	0	2'200	0	2'200 CHF	101.50%	2'233'000.00	0.07	a)
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	2'250	0	2'250 CHF	102.55%	2'307'375.00	0.07	a)
CH1350727785	1.6500 % SCMNVX 1.65 08/23/30	0	7'100	0	7'100 CHF	103.00%	7'313'000.00	0.23	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMNVX 1.8 08/23/34	0	11'175	0	11'175 CHF	105.35%	11'772'862.50	0.37	a)
CH1350727801	2.0000 % SCMNVX 2 11/23/39	0	9'200	0	9'200 CHF	107.95%	9'931'400.00	0.32	a)
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	0	4'640	0	4'640 CHF	102.05%	4'735'120.00	0.15	a)
CH1353257764	2.5000 % FERHOL 2 1/2 06/28/33	0	3'260	0	3'260 CHF	104.55%	3'408'330.00	0.11	a)
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	5'715	0	5'715 CHF	103.75%	5'929'312.50	0.19	a)
CH1353257806	1.6000 % NOVNVX 1.6 06/18/27	0	15'300	0	15'300 CHF	101.95%	15'598'350.00	0.50	a)
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	0	10'275	0	10'275 CHF	103.85%	10'670'587.50	0.34	a)
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	0	13'600	0	13'600 CHF	105.90%	14'402'400.00	0.46	a)
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	0	6'900	0	6'900 CHF	108.85%	7'510'650.00	0.24	a)
CH1353257848	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/49	0	4'700	0	4'700 CHF	114.15%	5'365'050.00	0.17	a)
CH1353257905	2.0000 % BNS 2 08/02/30 EMTN	0	4'300	0	4'300 CHF	103.90%	4'467'700.00	0.14	a)
CH1353257913	1.9950 % EFGBNK 1.995 06/28/27	0	5'700	0	5'700 CHF	101.40%	5'779'800.00	0.18	a)
CH1353257921	2.1575 % EFGBNK 2.1575 06/28/30	0	4'150	0	4'150 CHF	102.90%	4'270'350.00	0.14	a)
CH1353257939	1.6250 % KWOPER 1 5/8 07/16/32	0	4'060	0	4'060 CHF	103.10%	4'185'860.00	0.13	a)
CH1356197108	2.1500 % TRAGR 2.15 06/18/27 EMTN	0	5'850	0	5'850 CHF	101.55%	5'940'675.00	0.19	a)
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	0	4'911	0	4'911 CHF	103.35%	5'075'924.67	0.16	a)
CH1356570312	1.7425 % EDF 1.7425 09/06/32 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	99.64%	3'487'365.00	0.11	a)
CH1356570320	1.9875 % CMZB 1.9875 09/09/31	0	5'400	0	5'400 CHF	99.79%	5'388'390.00	0.17	a)
CH1357852651	1.6925 % SRAIL 1.6925 07/12/29	0	3'500	0	3'500 CHF	101.35%	3'547'250.00	0.11	a)
CH1357852669	1.9950 % SRAIL 1.995 07/12/32	0	2'900	0	2'900 CHF	102.15%	2'962'350.00	0.09	a)
CH1357852677	1.3800 % IBESM 1.38 07/11/28 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	100.95%	3'634'200.00	0.12	a)
CH1357852685	1.5625 % IBESM 1.5625 07/11/31 EMTN	0	4'650	0	4'650 CHF	101.05%	4'698'825.00	0.15	a)
CH1357852750	1.5100 % BHH 1.51 07/31/30 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	100.70%	2'920'300.00	0.09	a)
CH1357852784	1.4500 % IRENSW 1.45 10/16/26	0	2'600	0	2'600 CHF	100.35%	2'609'100.00	0.08	a)
CH1357852800	2.0000 % ANNGR 2 08/26/31 EMTN	0	5'300	0	5'300 CHF	100.75%	5'339'750.00	0.17	a)
CH1357852818	1.4450 % NWG 1.445 08/27/29 EMTN	0	5'200	0	5'200 CHF	100.15%	5'207'800.00	0.17	a)
CH1357852826	1.3075 % NONGNO 1.3075 08/28/30 EMTN	0	4'100	0	4'100 CHF	99.90%	4'095'900.00	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1359203382	2.3450 % SANTAN 2.345 07/03/31 EMTN	0	5'700	0	5'700 CHF	103.55%	5'902'350.00	0.19	a)
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	0	2'945	0	2'945 CHF	101.25%	2'981'812.50	0.09	a)
CH1361401743	1.4000 % IWBBAS 1.4 07/13/34	0	3'420	0	3'420 CHF	102.20%	3'495'240.00	0.11	a)
CH1361401875	1.2000 % SCMNVX 1.2 09/03/35	0	2'700	0	2'700 CHF	99.65%	2'690'550.00	0.09	a)
CH1361401883	1.1250 % GEBNVX 1 1/8 09/10/31	0	4'800	0	4'800 CHF	100.20%	4'809'504.00	0.15	a)
CH1361401891	1.5606 % BCHNSW 1.5606 09/29/28	0	3'900	0	3'900 CHF	99.93%	3'897'426.00	0.12	a)
CH1371736781	1.2925 % DNBNO 1.2925 03/05/31 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	99.97%	2'999'100.00	0.10	a)
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	5'300	0	5'300 CHF	99.83%	5'290'725.00	0.17	a)
CH1373904353	1.2000 % PSPNSW 1.2 09/20/29	0	4'200	0	4'200 CHF	99.78%	4'190'844.00	0.13	a)
CH1373904361	1.4000 % PSPNSW 1.4 09/20/34	0	3'600	0	3'600 CHF	99.25%	3'573'036.00	0.11	a)
CH1373904387	1.3000 % KENOVA 1.3 09/26/34	0	3'600	0	3'600 CHF	99.91%	3'596'760.00	0.11	a)
CH1373904403	1.6000 % GALDSW 1.6 09/27/28	0	6'000	0	6'000 CHF	100.38%	6'023'040.00	0.19	a)
CH1373904411	1.9000 % GALDSW 1.9 09/27/32	0	6'200	0	6'200 CHF	100.35%	6'221'762.00	0.20	a)
CH1373904429	1.5000 % UNIZUE 1 1/2 09/27/32	0	3'900	0	3'900 CHF	100.30%	3'911'700.00	0.12	a)
CH1373904437	1.6500 % UNIZUE 1.65 09/26/36	0	3'900	0	3'900 CHF	100.32%	3'912'597.00	0.12	a)
CH1377443804	1.6500 % ZUGNSW 1.65 09/16/31	0	2'700	0	2'700 CHF	99.75%	2'693'169.00	0.09	a)
CH1377443812	2.1275 % ECLCI 2.1275 09/26/29	0	3'000	0	3'000 CHF	99.96%	2'998'770.00	0.10	a)
<b>CHF</b>							<b>3'115'178'181.67</b>	<b>99.12</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'819'551.30	0.09
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'115'178'181.67	99.12
Sonstige Vermögenswerte	24'811'583.35	0.79
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'142'809'316.32</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-10'749.28	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'142'798'567.04</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	3'115'178'181.67	99.12
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

## 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 - 0.44	-	0.269	-	-	-
GA 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.

## 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	0.160	0.500	0.110	0.050	3.000
GA CHF	0.120	0.350	0.070	0.050	3.000
GT CHF	0.120	0.350	0.070	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.

## 8 Benchmark

SBI® Corporate 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.