

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 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	114034068	CHF
GT CHF	114034069	CHF
NT CHF	114034070	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	35
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	35
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	35
7	Pauschale Verwaltungskommission	36
8	Benchmark	36
9	TER	36
10	Fussnoten	37
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	38

# 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
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'586'052'402.56	2'813'525'260.29	1'627'502'081.77	1'305'104'925.17
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'722'940.20	13'889'410.84	8'632'873.28	3'334'651.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		257'451.354	148'433.477	97'090.678	34'443.647
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		96.0296	93.5733	88.9156	96.8147
Ausschüttung je Anteil		-	0.75	0.65	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		712'785'629.49	583'988'440.93	350'184'239.78	267'262'270.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'338'994.918	6'203'828.246	3'936'444.429	2'759'933.150
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		97.1231	94.1336	88.9595	96.8365
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		103.4155	98.7881	89.5005	93.9719
Thesaurierung je Anteil		-	0.81	0.63	0.14
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.11 %	0.11 %	0.11 %	0.11 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'848'543'832.87	2'215'647'408.52	1'268'684'968.71	1'034'508'003.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		39'538'050.153	23'489'615.793	14'242'680.935	10'679'303.775
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		97.3377	94.3245	89.0763	96.8704
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		103.6441	98.9886	89.6180	94.0047
Thesaurierung je Anteil		-	0.91	0.73	0.18
Total Expense Ratio (Synthetische 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 04.11.2021)	3.45 %	7.13 %	-11.82 %	0.04 %
Klasse GT CHF (Lancierung 04.11.2021)	3.49 %	7.20 %	-11.75 %	0.06 %
Klasse NT CHF (Lancierung 04.11.2021)	3.54 %	7.32 %	-11.65 %	0.07 %
Benchmark	3.55 %	7.36 %	-12.10 %	-0.16 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	-	0.11 %	0.27 %	0.23 %

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 04.11.2021)	-0.10 %
Klasse GT CHF (Lancierung 04.11.2021)	-0.06 %
Klasse NT CHF (Lancierung 04.11.2021)	-0.01 %

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	2'288'648.05	10'817'811.92
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'290'528'379.90	2'021'425'639.80
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'269'242'347.78	765'837'424.74
Sonstige Vermögenswerte	24'061'072.52	15'494'311.65
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'120'448.25</b>	<b>2'813'575'188.11</b>
Andere Verbindlichkeiten	-68'045.69	-49'927.82
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'052'402.56</b>	<b>2'813'525'260.29</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		148'433.477	97'090.678
Ausgegebene Anteile		125'586.503	58'986.767
Zurückgenommene Anteile		-16'568.626	-7'643.968
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>257'451.354</b>	<b>148'433.477</b>

Klasse GT CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		6'203'828.246	3'936'444.429
Ausgegebene Anteile		1'601'324.850	3'166'774.313
Zurückgenommene Anteile		-466'158.178	-899'390.496
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>7'338'994.918</b>	<b>6'203'828.246</b>

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		23'489'615.793	14'242'680.935
Ausgegebene Anteile		2'051'897.875	6'690'916.951
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		15'106'339.187	3'584'144.448
Zurückgenommene Anteile		-854'902.702	-1'028'126.541
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-254'900.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>39'538'050.153</b>	<b>23'489'615.793</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	21.05.2024	117'199'575.78	1'236'878.704
Klasse NT CHF	24.05.2024	273'611'711.73	2'893'757.448
Klasse NT CHF	20.06.2024	7'682'003.56	80'779.270
Klasse NT CHF	20.06.2024	40'301'340.96	423'784.352
Klasse NT CHF	20.06.2024	11'405'720.50	119'935.609
Klasse NT CHF	25.06.2024	34'558'891.58	361'139.209
Klasse NT CHF	26.06.2024	477'530'943.57	4'993'275.916
Klasse NT CHF	11.07.2024	479'273'481.97	4'996'788.679

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	21.08.2024	8'842'673.55	90'500.000
Klasse NT CHF	22.08.2024	16'024'725.60	164'400.000

## 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		2'813'525'260.29	1'627'502'081.77
Ausbezahlte Ausschüttung		-185'408.33	-72'645.70
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-11'013'840.00	-5'916'474.81
Saldo aus dem Anteilverkehr		1'641'100'893.97	1'055'599'759.32
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		142'625'496.63	136'412'539.71
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>4'586'052'402.56</b>	<b>2'813'525'260.29</b>

## Erfolgsrechnung

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Konsolidiert</b>			
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		64'236.90	53'281.56
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		13'933'601.09	17'510'283.32
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		10'370'888.13	4'634'388.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		7'843'499.11	6'084'020.88
<b>Total Ertrag</b>		<b>32'212'225.23</b>	<b>28'281'974.51</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-3.95	0.00
Reglementarische Vergütungen		-384'405.95	-563'302.70
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-520'866.33	-1'026'767.59
<b>Total Aufwand</b>		<b>-905'276.23</b>	<b>-1'590'070.29</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>31'306'949.00</b>	<b>26'691'904.22</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-8'880'523.98	-7'518'137.81
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		1'118'057.03	3'251'910.21
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>23'544'482.05</b>	<b>22'425'676.62</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		119'081'014.58	113'986'863.09
<b>Gesamterfolg</b>		<b>142'625'496.63</b>	<b>136'412'539.71</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>3'290'528'379.90</b>	<b>71.75</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>3'290'528'379.90</b>	<b>71.75</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	30'000	17'284	0	47'284 CHF	112.44%	53'166'129.60	1.16	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	15'080	8'042	0	23'122 CHF	181.70%	42'012'674.00	0.92	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	24'390	14'940	0	39'330 CHF	125.61%	49'402'413.00	1.08	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	3'060	2'000	0	5'060 CHF	110.60%	5'596'360.00	0.12	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	2'490	0	2'490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	6'270	3'810	0	10'080 CHF	111.05%	11'193'840.00	0.24	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	3'930	1'495	5'425	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	6'810	2'115	0	8'925 CHF	101.60%	9'067'800.00	0.20	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	1'110	300	0	1'410 CHF	101.73%	1'434'393.00	0.03	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	1'580	840	0	2'420 CHF	108.85%	2'634'170.00	0.06	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	2'070	1'400	0	3'470 CHF	118.45%	4'110'215.00	0.09	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	750	200	0	950 CHF	102.32%	972'040.00	0.02	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	24'975	13'322	0	38'297 CHF	122.98%	47'097'650.60	1.03	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	5'870	3'150	0	9'020 CHF	103.55%	9'340'210.00	0.20	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'760	0	1'760	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	2'010	1'245	0	3'255 CHF	125.75%	4'093'162.50	0.09	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	1'410	500	1'910	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	790	1'130	0	1'920 CHF	126.40%	2'426'880.00	0.05	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	2'660	655	0	3'315 CHF	111.35%	3'691'252.50	0.08	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN	2'000	700	0	2'700 CHF	115.30%	3'113'100.00	0.07	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	0	1'870	1'870	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	890	405	0	1'295 CHF	113.55%	1'470'472.50	0.03	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	3'010	2'070	0	5'080 CHF	113.80%	5'781'040.00	0.13	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	4'530	0	4'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'080	200	0	1'280 CHF	122.35%	1'566'080.00	0.03	a)
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	2'200	1'425	0	3'625 CHF	106.40%	3'857'000.00	0.08	a)
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	350	1'050	0	1'400 CHF	128.55%	1'799'700.00	0.04	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	16'670	9'312	0	25'982 CHF	107.64%	27'967'024.80	0.61	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	1'200	1'285	0	2'485 CHF	108.05%	2'685'042.50	0.06	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	1'190	0	1'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	810	0	810	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109497690	2.7500 % WINCTY 2 3/4 01/28/30	100	0	0	100 CHF	110.05%	110'050.00	0.00	a)
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	1'670	0	0	1'670 CHF	109.11%	1'822'137.00	0.04	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	2'310	495	0	2'805 CHF	100.97%	2'832'208.50	0.06	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	1'200	580	0	1'780 CHF	105.35%	1'875'230.00	0.04	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	3'530	2'600	0	6'130 CHF	109.61%	6'719'093.00	0.15	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	2'780	2'880	0	5'660 CHF	101.00%	5'716'600.00	0.12	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	780	335	0	1'115 CHF	105.15%	1'172'422.50	0.03	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	4'630	3'235	0	7'865 CHF	106.12%	8'346'338.00	0.18	a)
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	0	1'235	1'235	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	600	300	0	900 CHF	101.80%	916'200.00	0.02	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	530	200	0	730 CHF	103.35%	754'455.00	0.02	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	1'350	0	0	1'350 CHF	106.30%	1'435'050.00	0.03	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	2'600	400	0	3'000 CHF	101.25%	3'037'500.00	0.07	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	1'050	0	0	1'050 CHF	106.85%	1'121'925.00	0.02	a)
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	1'220	0	0	1'220 CHF	112.00%	1'366'400.00	0.03	a)
CH0119533278	3.1250 % UBS 3 1/8 11/12/30 EMTN	0	285	285	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'360	0	0	2'360 CHF	108.85%	2'568'860.00	0.06	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	1'250	750	0	2'000 CHF	105.15%	2'103'000.00	0.05	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	5'530	1'950	0	7'480 CHF	104.97%	7'851'756.00	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.
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	1'800	2'600	0	4'400 CHF	103.83%	4'568'520.00	0.10 a)	
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	5'850	3'185	0	9'035 CHF	110.33%	9'968'315.50	0.22 a)	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'230	495	0	1'725 CHF	101.65%	1'753'462.50	0.04 a)	
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	1'420	150	0	1'570 CHF	102.30%	1'606'110.00	0.04 a)	
CH0126325353	2.3750 % NSWTC 2 3/8 04/26/41 EMTN	300	0	0	300 CHF	120.90%	362'700.00	0.01 a)	
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	2'330	1'205	0	3'535 CHF	102.48%	3'622'668.00	0.08 a)	
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	200	0	0	200 CHF	119.45%	238'900.00	0.01 a)	
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	580	0	0	580 CHF	124.65%	722'970.00	0.02 a)	
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'140	350	0	1'490 CHF	102.35%	1'525'015.00	0.03 a)	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	19'890	8'230	0	28'120 CHF	111.80%	31'438'160.00	0.69 a)	
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	23'373	13'316	0	36'689 CHF	117.39%	43'069'217.10	0.94 a)	
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	22'100	12'919	0	35'019 CHF	109.87%	38'475'375.30	0.84 a)	
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	3'100	805	1'000	2'905 CHF	102.28%	2'971'234.00	0.06 a)	
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	600	0	0	600 CHF	108.65%	651'900.00	0.01 a)	
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	500	1'450	0	1'950 CHF	110.60%	2'156'700.00	0.05 a)	
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	2'300	4'005	0	6'305 CHF	104.19%	6'569'179.50	0.14 a)	
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	1'030	0	0	1'030 CHF	122.60%	1'262'780.00	0.03 a)	
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	750	520	0	1'270 CHF	109.70%	1'393'190.00	0.03 a)	
CH0132163434	2.8750 % KWLLIJ 2 7/8 06/30/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	4'660	1'835	2'000	4'495 CHF	101.65%	4'569'167.50	0.10 a)	
CH0137992803	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41	0	1'975	0	1'975 CHF	113.80%	2'247'550.00	0.05 a)	
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	1'060	0	1'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	980	300	0	1'280 CHF	100.87%	1'291'136.00	0.03 a)	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	2'360	0	0	2'360 CHF	102.30%	2'414'280.00	0.05 a)	
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	670	650	0	1'320 CHF	117.05%	1'545'060.00	0.03 a)	
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	750	0	0	750 CHF	109.23%	819'225.00	0.02 a)	
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	1'400	1'100	0	2'500 CHF	101.20%	2'530'000.00	0.06 a)	
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	3'050	1'850	0	4'900 CHF	101.91%	4'993'590.00	0.11 a)	
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	2'290	0	0	2'290 CHF	106.27%	2'433'583.00	0.05 a)	
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	1'910	1'150	0	3'060 CHF	104.75%	3'205'350.00	0.07 a)	
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'880	410	0	2'290 CHF	101.25%	2'318'625.00	0.05 a)	
CH018006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	2'050	895	0	2'945 CHF	101.35%	2'984'757.50	0.07 a)	
CH0180428531	2.8750 % KWLLIJ 2 7/8 03/27/42	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	3'300	1'295	0	4'595 CHF	101.13%	4'646'923.50	0.10 a)	
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	1'450	600	0	2'050 CHF	105.20%	2'156'600.00	0.05 a)	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	900	0	0	900 CHF	101.30%	911'700.00	0.02 a)	
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	1'165	200	0	1'365 CHF	110.80%	1'512'420.00	0.03 a)	
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	400	505	0	905 CHF	101.60%	919'480.00	0.02 a)	
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	3'400	1'495	0	4'895 CHF	102.46%	5'015'417.00	0.11 a)	
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	5'090	2'060	0	7'150 CHF	101.53%	7'259'395.00	0.16 a)	
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	20'560	6'798	12'000	15'358 CHF	100.68%	15'462'434.40	0.34 a)	
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	680	230	0	910 CHF	105.80%	962'780.00	0.02 a)	
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	2'540	1'900	0	4'440 CHF	101.85%	4'522'140.00	0.10 a)	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	4'980	910	0	5'890 CHF	102.55%	6'040'195.00	0.13 a)	
CH0185577837	1.4500 % KBFRI 1.45 06/07/27	750	0	0	750 CHF	101.05%	757'875.00	0.02 a)	
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	1'390	1'500	0	2'890 CHF	101.40%	2'930'460.00	0.06 a)	
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	1'500	720	0	2'220 CHF	101.45%	2'252'190.00	0.05 a)	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	4'200	1'460	0	5'660 CHF	104.00%	5'886'400.00	0.13 a)	
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	2'350	3'585	0	5'935 CHF	101.31%	6'012'748.50	0.13 a)	
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	1'310	400	0	1'710 CHF	101.35%	1'733'085.00	0.04 a)	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	4'690	2'830	0	7'520 CHF	102.13%	7'680'176.00	0.17 a)	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	1'000	440	0	1'440 CHF	100.90%	1'452'960.00	0.03 a)	
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	780	0	780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	530	0	0	530 CHF	102.35%	542'455.00	0.01 a)	
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	830	600	0	1'430 CHF	100.25%	1'433'575.00	0.03 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	700	1'750	0	2'450 CHF	103.85%	2'544'325.00	0.06	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	2'450	400	0	2'850 CHF	101.10%	2'881'350.00	0.06	a)
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	250	0	0	250 CHF	105.90%	264'750.00	0.01	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	890	1'270	0	2'160 CHF	101.45%	2'191'320.00	0.05	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	5'050	2'745	500	7'295 CHF	101.38%	7'395'671.00	0.16	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	2'140	190	0	2'330 CHF	102.15%	2'380'095.00	0.05	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	1'000	1'000	0	2'000 CHF	103.10%	2'062'000.00	0.04	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	710	0	0	710 CHF	112.00%	795'200.00	0.02	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	1'000	710	0	1'710 CHF	102.45%	1'751'895.00	0.04	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	150	3'000	2'150	1'000 CHF	100.15%	1'001'500.00	0.02	a)
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	2'970	495	0	3'465 CHF	101.15%	3'504'847.50	0.08	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'180	350	0	1'530 CHF	112.45%	1'720'485.00	0.04	a)
CH0208271541	3.0000 % KWLLIL 3 04/02/48	0	270	270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	1'500	0	0	1'500 CHF	107.45%	1'611'750.00	0.04	a)
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	630	500	1'130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	750	450	0	1'200 CHF	102.30%	1'227'600.00	0.03	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	4'350	0	4'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	4'640	1'770	0	6'410 CHF	103.81%	6'654'221.00	0.15	a)
CH0212114653	1.8000 % TESSIN 1.8 05/15/43	1'640	0	0	1'640 CHF	114.95%	1'885'180.00	0.04	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	1'030	2'495	0	3'525 CHF	108.30%	3'817'575.00	0.08	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	330	0	330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	520	0	0	520 CHF	112.60%	585'520.00	0.01	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'770	1'595	0	3'365 CHF	102.70%	3'455'855.00	0.08	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	530	150	0	680 CHF	115.95%	788'460.00	0.02	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	2'860	500	0	3'360 CHF	102.10%	3'430'560.00	0.07	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	830	0	0	830 CHF	108.25%	898'475.00	0.02	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	2'950	1'600	4'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	1'470	750	0	2'220 CHF	103.80%	2'304'360.00	0.05	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	1'060	700	0	1'760 CHF	114.90%	2'022'240.00	0.04	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	900	0	0	900 CHF	101.60%	914'400.00	0.02	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	770	290	0	1'060 CHF	115.65%	1'225'890.00	0.03	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	1'100	0	0	1'100 CHF	101.19%	1'113'090.00	0.02	a)
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	500	520	0	1'020 CHF	111.40%	1'136'280.00	0.02	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'240	250	0	1'490 CHF	101.80%	1'516'820.00	0.03	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	2'190	670	0	2'860 CHF	107.05%	3'061'630.00	0.07	a)
CH0223643260	2.1250 % BERCTY 2 1/8 10/11/38	100	0	0	100 CHF	115.75%	115'750.00	0.00	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	20'295	11'718	0	32'013 CHF	101.20%	32'397'156.00	0.71	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	18'210	10'876	0	29'086 CHF	163.00%	47'410'180.00	1.03	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	19'320	12'548	0	31'868 CHF	100.01%	31'871'186.80	0.69	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	11'590	6'002	0	17'592 CHF	103.24%	18'161'980.80	0.40	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	25'818	15'884	0	41'702 CHF	97.67%	40'730'343.40	0.89	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	2'420	1'450	0	3'870 CHF	110.75%	4'286'025.00	0.09	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	250	500	0	750 CHF	110.70%	830'250.00	0.02	a)
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	400	200	0	600 CHF	100.80%	604'800.00	0.01	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	2'185	0	2'185	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228138274	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/38	0	650	0	650 CHF	114.50%	744'250.00	0.02	a)
CH0228138282	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/43	300	350	0	650 CHF	119.65%	777'725.00	0.02	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLLIL 2 3/8 12/10/26	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	100	0	0	100 CHF	119.55%	119'550.00	0.00	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	2'200	2'780	0	4'980 CHF	109.78%	5'467'044.00	0.12	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	950	1'120	0	2'070 CHF	117.90%	2'440'530.00	0.05	a)
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	620	0	0	620 CHF	117.65%	729'430.00	0.02	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	2'910	0	2'910	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	8'020	1'245	3'500	5'765 CHF	101.25%	5'837'062.50	0.13	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	350	0	0	350 CHF	104.30%	365'050.00	0.01	a)
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	1'440	0	0	1'440 CHF	119.66%	1'723'104.00	0.04	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	690	500	0	1'190 CHF	100.67%	1'197'973.00	0.03	a)
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	1'830	1'645	0	3'475 CHF	100.75%	3'501'062.50	0.08	a)
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	400	750	0	1'150 CHF	102.95%	1'183'925.00	0.03	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'950	2'475	0	4'425 CHF	102.40%	4'531'200.00	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.
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	1'500	865	0	2'365 CHF	103.85%	2'456'052.50	0.05	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 07/14/26	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	1'280	0	0	1'280 CHF	100.35%	1'284'480.00	0.03	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	0	700	0	700 CHF	104.85%	733'950.00	0.02	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	930	320	0	1'250 CHF	102.50%	1'281'250.00	0.03	a)
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	1'730	600	0	2'330 CHF	100.65%	2'345'145.00	0.05	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	2'700	950	0	3'650 CHF	105.45%	3'848'925.00	0.08	a)
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	0	375	375	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'200	1'305	0	2'505 CHF	100.55%	2'518'777.50	0.05	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	2'730	150	0	2'880 CHF	101.75%	2'930'400.00	0.06	a)
CH0254147504	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 09/28/29	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	2'170	1'000	0	3'170 CHF	100.80%	3'195'360.00	0.07	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	1'900	1'000	0	2'900 CHF	100.17%	2'904'930.00	0.06	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	4'850	2'075	0	6'925 CHF	102.92%	7'127'210.00	0.16	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	300	0	0	300 CHF	98.75%	296'250.00	0.01	a)
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	550	805	0	1'355 CHF	104.56%	1'416'788.00	0.03	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	600	1'650	0	2'250 CHF	101.49%	2'283'525.00	0.05	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	890	1'000	0	1'890 CHF	100.20%	1'893'780.00	0.04	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	330	0	330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	0	445	445	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	910	0	910	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	1'030	0	1'030	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	1'580	500	0	2'080 CHF	106.65%	2'218'320.00	0.05	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	1'350	2'200	0	3'550 CHF	99.15%	3'519'825.00	0.08	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	8'840	2'620	0	11'460 CHF	100.27%	11'490'942.00	0.25	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	3'390	0	3'390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	1'820	0	1'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	790	350	0	1'140 CHF	98.80%	1'126'320.00	0.02	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	4'680	2'175	0	6'855 CHF	97.00%	6'649'350.00	0.14	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	1'300	600	0	1'900 CHF	99.01%	1'881'190.00	0.04	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	450	1'330	0	1'780 CHF	97.70%	1'739'060.00	0.04	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	860	1'400	0	2'260 CHF	97.30%	2'198'980.00	0.05	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	4'000	2'760	0	6'760 CHF	98.20%	6'638'320.00	0.14	a)
CH0268988182	1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269382088	0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	1'420	1'455	0	2'875 CHF	98.35%	2'827'562.50	0.06	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	1'100	700	0	1'800 CHF	98.30%	1'769'400.00	0.04	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	1'780	900	0	2'680 CHF	97.55%	2'614'340.00	0.06	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	1'240	1'500	0	2'740 CHF	98.05%	2'686'570.00	0.06	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'890	400	0	2'290 CHF	103.30%	2'365'570.00	0.05	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'240	0	1'240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	700	0	0	700 CHF	98.65%	690'550.00	0.02	a)
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	0	830	830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	4'760	1'835	0	6'595 CHF	98.46%	6'493'437.00	0.14	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	1'700	0	0	1'700 CHF	98.11%	1'667'870.00	0.04	a)
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	1'200	1'000	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	980	0	0	980 CHF	102.35%	1'003'030.00	0.02	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	5'150	0	5'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	3'900	2'725	0	6'625 CHF	98.45%	6'522'312.50	0.14	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27	860	850	0	1'710 CHF	98.75%	1'688'625.00	0.04	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	1'750	0	0	1'750 CHF	99.00%	1'732'500.00	0.04	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'570	2'400	2'000	2'970 CHF	99.58%	2'957'526.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	950	800	0	1'750 CHF	98.55%	1'724'625.00	0.04	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	1'945	1'565	0	3'510 CHF	98.25%	3'448'575.00	0.08	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	4'360	2'055	0	6'415 CHF	96.71%	6'203'946.50	0.14	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	3'330	4'330	0	7'660 CHF	97.56%	7'473'096.00	0.16	a)
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	950	0	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	1'230	150	0	1'380 CHF	97.05%	1'339'290.00	0.03	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	3'600	1'400	0	5'000 CHF	96.36%	4'818'000.00	0.11	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	3'260	1'890	0	5'150 CHF	97.30%	5'010'950.00	0.11	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	1'980	5'105	0	7'085 CHF	99.84%	7'073'664.00	0.15	a)
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	960	1'155	0	2'115 CHF	99.95%	2'113'942.50	0.05	a)
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	0	1'260	1'260	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	3'700	0	0	3'700 CHF	100.03%	3'701'110.00	0.08	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	1'220	3'145	0	4'365 CHF	101.39%	4'425'673.50	0.10	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	1'100	0	0	1'100 CHF	99.66%	1'096'260.00	0.02	a)
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	860	1'960	0	2'820 CHF	103.30%	2'913'060.00	0.06	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	1'460	505	0	1'965 CHF	99.40%	1'953'210.00	0.04	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	4'470	3'065	0	7'535 CHF	99.16%	7'471'706.00	0.16	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	2'700	500	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	700	700	0	1'400 CHF	99.68%	1'395'520.00	0.03	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	2'600	1'230	0	3'830 CHF	99.26%	3'801'658.00	0.08	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	0	1'165	1'165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	4'600	2'760	0	7'360 CHF	97.71%	7'191'456.00	0.16	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	0	445	0	445 CHF	99.31%	441'929.50	0.01	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	2'780	1'000	0	3'780 CHF	99.43%	3'758'454.00	0.08	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	6'960	2'560	1'000	8'520 CHF	99.41%	8'469'732.00	0.18	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	1'750	950	0	2'700 CHF	99.33%	2'681'910.00	0.06	a)
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	770	700	0	1'470 CHF	98.15%	1'442'805.00	0.03	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	0	1'245	1'245	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	1'280	595	0	1'875 CHF	98.60%	1'848'750.00	0.04	a)
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	490	0	490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	2'200	0	0	2'200 CHF	97.94%	2'154'680.00	0.05	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	1'300	725	0	2'025 CHF	99.07%	2'006'167.50	0.04	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	4'000	2'460	0	6'460 CHF	97.93%	6'326'278.00	0.14	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	200	1'215	0	1'415 CHF	98.15%	1'388'822.50	0.03	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	0	490	490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'860	450	0	2'310 CHF	98.30%	2'270'730.00	0.05	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	3'350	5'815	0	9'165 CHF	96.99%	8'889'133.50	0.19	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	1'150	620	0	1'770 CHF	98.70%	1'746'990.00	0.04	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	1'540	820	0	2'360 CHF	98.84%	2'332'624.00	0.05	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	0	480	480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	500	400	0	900 CHF	98.15%	883'350.00	0.02	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	650	0	0	650 CHF	97.45%	633'425.00	0.01	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	2'610	1'225	0	3'835 CHF	98.81%	3'789'363.50	0.08	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	4'240	2'025	0	6'265 CHF	97.34%	6'098'351.00	0.13	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	3'100	2'310	0	5'410 CHF	97.68%	5'284'488.00	0.12	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	3'610	3'705	0	7'315 CHF	94.98%	6'947'787.00	0.15	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	4'950	1'350	0	6'300 CHF	98.75%	6'221'250.00	0.14	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	1'000	545	0	1'545 CHF	98.75%	1'525'687.50	0.03	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310646523	0.5000 % KBFRIE 0 1/2 02/23/28	870	1'585	0	2'455 CHF	97.85%	2'402'217.50	0.05	a)
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	0	300	0	300 CHF	97.35%	292'050.00	0.01	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	3'020	2'255	0	5'275 CHF	94.93%	5'007'557.50	0.11	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'080	750	0	1'830 CHF	98.84%	1'808'772.00	0.04	a)
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	1'640	800	0	2'440 CHF	94.65%	2'309'460.00	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.
CH0317921663	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 03/31/28	0	1'145	1'145	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	4'730	3'635	0	8'365 CHF	98.14%	8'209'411.00	0.18	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	1'450	1'600	0	3'050 CHF	98.50%	3'004'250.00	0.07	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKBK 0 1/4 05/27/26	700	120	0	820 CHF	98.50%	807'700.00	0.02	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	6'910	2'430	0	9'340 CHF	95.48%	8'917'832.00	0.19	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	3'910	3'395	0	7'305 CHF	96.85%	7'074'892.50	0.15	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	2'880	2'850	0	5'730 CHF	95.58%	5'476'734.00	0.12	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	3'140	1'400	0	4'540 CHF	94.07%	4'270'778.00	0.09	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	0	295	295	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	200	550	0	750 CHF	98.15%	736'125.00	0.02	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	940	250	0	1'190 CHF	95.35%	1'134'665.00	0.02	a)
CH0320712604	0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	1'250	2'005	0	3'255 CHF	95.20%	3'098'760.00	0.07	a)
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	0	1'020	1'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	4'490	2'565	0	7'055 CHF	97.41%	6'872'275.50	0.15	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	1'610	750	0	2'360 CHF	94.45%	2'229'020.00	0.05	a)
CH0326213953	0.7500 % KISPIZ 0 3/4 07/28/36	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	650	250	0	900 CHF	96.60%	869'400.00	0.02	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	3'140	1'720	0	4'860 CHF	90.59%	4'402'674.00	0.10	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	1'250	300	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'070	250	0	2'320 CHF	90.45%	2'098'440.00	0.05	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'750	1'800	0	4'550 CHF	97.05%	4'415'775.00	0.10	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	4'410	1'500	0	5'910 CHF	89.46%	5'287'086.00	0.12	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	890	250	0	1'140 CHF	99.13%	1'130'082.00	0.02	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	500	200	0	700 CHF	94.50%	661'500.00	0.01	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	1'150	0	0	1'150 CHF	98.45%	1'132'175.00	0.02	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	1'960	665	0	2'625 CHF	96.50%	2'533'125.00	0.06	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	3'630	1'000	0	4'630 CHF	94.29%	4'365'627.00	0.10	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	2'050	2'290	0	4'340 CHF	88.25%	3'830'050.00	0.08	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	3'460	2'425	0	5'885 CHF	87.85%	5'169'972.50	0.11	a)
CH0336352775	0.1250 % SCMN VX 0 1/8 09/15/32	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	730	300	0	1'030 CHF	98.05%	1'009'915.00	0.02	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	4'120	4'285	0	8'405 CHF	97.83%	8'222'611.50	0.18	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	2'300	3'070	0	5'370 CHF	94.09%	5'052'633.00	0.11	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	3'800	1'200	0	5'000 CHF	98.15%	4'907'500.00	0.11	a)
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	0	285	285	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	2'820	1'540	0	4'360 CHF	93.15%	4'061'340.00	0.09	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	3'460	1'815	0	5'275 CHF	88.91%	4'690'002.50	0.10	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	2'760	1'030	0	3'790 CHF	90.66%	3'436'014.00	0.07	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	1'060	1'550	0	2'610 CHF	96.00%	2'505'600.00	0.05	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	455	455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	670	640	0	1'310 CHF	90.65%	1'187'515.00	0.03	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	1'000	1'700	0	2'700 CHF	91.25%	2'463'750.00	0.05	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	1'910	1'000	0	2'910 CHF	97.80%	2'845'980.00	0.06	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	930	100	0	1'030 CHF	89.40%	920'820.00	0.02	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'230	0	0	1'230 CHF	94.50%	1'162'350.00	0.03	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	0	900	0	900 CHF	94.40%	849'600.00	0.02	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	2'790	0	2'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	2'450	0	0	2'450 CHF	97.80%	2'396'100.00	0.05	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	500	0	0	500 CHF	97.55%	487'750.00	0.01	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	1'400	650	0	2'050 CHF	97.85%	2'005'925.00	0.04	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	15'980	10'753	0	26'733 CHF	102.10%	27'294'393.00	0.60	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	20'970	9'887	0	30'857 CHF	100.64%	31'054'484.80	0.68	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	17'740	11'517	0	29'257 CHF	100.12%	29'292'108.40	0.64	a)
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	2'680	3'195	0	5'875 CHF	98.91%	5'810'962.50	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.
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	820	0	0	820 CHF	98.10%	804'420.00	0.02	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	545	0	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	300	0	0	300 CHF	97.00%	291'000.00	0.01	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	2'170	430	900	1'700 CHF	98.91%	1'681'470.00	0.04	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	3'590	2'600	6'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	2'870	1'660	0	4'530 CHF	98.07%	4'442'571.00	0.10	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	3'210	2'275	0	5'485 CHF	95.05%	5'213'492.50	0.11	a)
CH0350030422	0.7000 % KWOBER 0.7 01/30/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	3'550	3'470	0	7'020 CHF	98.36%	6'904'872.00	0.15	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	4'550	2'415	0	6'965 CHF	96.41%	6'714'956.50	0.15	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	935	935	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	650	760	0	1'410 CHF	97.80%	1'378'980.00	0.03	a)
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	2'200	0	0	2'200 CHF	97.67%	2'148'740.00	0.05	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'610	200	0	1'810 CHF	97.45%	1'763'845.00	0.04	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	2'460	700	0	3'160 CHF	98.10%	3'099'960.00	0.07	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	870	0	870	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	1'500	530	0	2'030 CHF	98.50%	1'999'550.00	0.04	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	810	0	0	810 CHF	98.70%	799'470.00	0.02	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNX 0 1/4 09/22/25 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	0	305	305	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	4'920	1'465	0	6'385 CHF	98.77%	6'306'464.50	0.14	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	6'070	3'490	0	9'560 CHF	97.72%	9'342'032.00	0.20	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	500	0	0	500 CHF	98.97%	494'850.00	0.01	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	1'100	600	0	1'700 CHF	96.35%	1'637'950.00	0.04	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	5'140	870	0	6'010 CHF	98.42%	5'915'042.00	0.13	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	4'650	4'695	0	9'345 CHF	98.27%	9'183'331.50	0.20	a)
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	2'820	2'210	0	5'030 CHF	98.87%	4'973'161.00	0.11	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	2'970	1'595	0	4'565 CHF	99.20%	4'528'480.00	0.10	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	960	150	0	1'110 CHF	96.50%	1'071'150.00	0.02	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	630	610	0	1'240 CHF	96.00%	1'190'400.00	0.03	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	780	1'205	0	1'985 CHF	98.05%	1'946'292.50	0.04	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	810	0	0	810 CHF	98.75%	799'875.00	0.02	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	800	300	0	1'100 CHF	97.50%	1'072'500.00	0.02	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	550	400	0	950 CHF	95.85%	910'575.00	0.02	a)
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	1'930	2'690	0	4'620 CHF	95.66%	4'419'492.00	0.10	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 05/31/27	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	640	1'000	0	1'640 CHF	95.95%	1'573'580.00	0.03	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	0	1'675	1'675	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'000	510	0	1'510 CHF	97.75%	1'476'025.00	0.03	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	1'095	300	0	1'395 CHF	98.50%	1'374'075.00	0.03	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	565	565	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	1'595	0	1'595	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	4'200	2'845	0	7'045 CHF	98.62%	6'947'779.00	0.15	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	1'465	0	0	1'465 CHF	94.00%	1'377'100.00	0.03	a)
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	0	380	380	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	2'560	3'955	0	6'515 CHF	97.82%	6'372'973.00	0.14	a)
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	500	0	0	500 CHF	97.10%	485'500.00	0.01	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 11/24/33	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	3'410	2'195	0	5'605 CHF	97.80%	5'481'690.00	0.12	a)
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'920	2'520	0	4'440 CHF	97.75%	4'340'100.00	0.09	a)
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	300	150	0	450 CHF	98.05%	441'225.00	0.01	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	4'640	1'470	0	6'110 CHF	98.40%	6'012'240.00	0.13	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	3'930	1'800	0	5'730 CHF	97.05%	5'560'965.00	0.12	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	1'650	1'500	0	3'150 CHF	98.98%	3'117'870.00	0.07	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	400	5'000	2'000	3'400 CHF	99.48%	3'382'320.00	0.07	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	5'960	2'900	0	8'860 CHF	98.20%	8'700'520.00	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.
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	1'950	250	0	2'200 CHF	98.00%	2'156'000.00	0.05	a)
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	1'630	0	1'630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	2'340	1'305	0	3'645 CHF	97.75%	3'562'987.50	0.08	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'000	1'480	900	2'580 CHF	97.85%	2'524'530.00	0.06	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	1'140	400	1'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	1'280	800	0	2'080 CHF	96.70%	2'011'360.00	0.04	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	4'530	3'700	0	8'230 CHF	97.94%	8'060'462.00	0.18	a)
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268706	0.4000 % GVAER 0.4 09/20/27	0	510	510	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	0	1'350	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	750	300	0	1'050 CHF	99.01%	1'039'605.00	0.02	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	1'250	1'900	0	3'150 CHF	98.35%	3'098'025.00	0.07	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	2'160	500	0	2'660 CHF	95.40%	2'537'640.00	0.06	a)
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	810	700	0	1'510 CHF	96.70%	1'460'170.00	0.03	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	0	235	235	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	1'405	1'405	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0383104343	0.5500 % NESNVX 0.55 10/04/32 EMTN	0	770	770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	3'460	1'020	0	4'480 CHF	98.75%	4'424'000.00	0.10	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	1'250	1'000	0	2'250 CHF	97.97%	2'204'325.00	0.05	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	880	0	0	880 CHF	95.85%	843'480.00	0.02	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	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	0	770	770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	0	705	705	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	770	250	0	1'020 CHF	96.00%	979'200.00	0.02	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	1'400	2'600	0	4'000 CHF	98.00%	3'920'000.00	0.09	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	1'560	2'800	0	4'360 CHF	98.20%	4'281'520.00	0.09	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	1'900	910	0	2'810 CHF	97.70%	2'745'370.00	0.06	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	940	175	0	1'115 CHF	98.84%	1'102'066.00	0.02	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	630	0	0	630 CHF	98.00%	617'400.00	0.01	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	1'665	600	200	2'065 CHF	97.75%	2'018'537.50	0.04	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	3'900	5'000	0	8'900 CHF	98.91%	8'802'990.00	0.19	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	870	755	0	1'625 CHF	97.55%	1'585'187.50	0.03	a)
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	1'460	250	0	1'710 CHF	99.17%	1'695'807.00	0.04	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	1'550	2'010	0	3'560 CHF	98.10%	3'492'360.00	0.08	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	1'400	4'000	5'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633336	0.3500 % WKBSNW 0.35 09/07/27	0	1'850	0	1'850 CHF	97.70%	1'807'450.00	0.04	a)
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'315	1'200	0	2'515 CHF	98.45%	2'476'017.50	0.05	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	1'350	2'300	0	3'650 CHF	98.76%	3'604'740.00	0.08	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	3'370	1'310	0	4'680 CHF	97.91%	4'582'188.00	0.10	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	4'420	3'280	0	7'700 CHF	98.64%	7'595'280.00	0.17	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	600	0	0	600 CHF	98.70%	592'200.00	0.01	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	650	685	0	1'335 CHF	97.95%	1'307'632.50	0.03	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	830	630	0	1'460 CHF	92.35%	1'348'310.00	0.03	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 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	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	0	545	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398913498	0.2000 % KBFRI 0.2 02/20/26	2'000	550	0	2'550 CHF	98.75%	2'518'125.00	0.05	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	1'130	250	0	1'380 CHF	101.85%	1'405'530.00	0.03	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	800	845	0	1'645 CHF	99.04%	1'629'208.00	0.04	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'320	0	1'320	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.
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	700	500	0	1'200 CHF	98.00%	1'176'000.00	0.03	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'900	3'000	3'900	1'000 CHF	99.53%	995'300.00	0.02	a)
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	790	0	790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'110	495	0	1'605 CHF	98.65%	1'583'332.50	0.03	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	1'100	1'700	0	2'800 CHF	99.00%	2'772'000.00	0.06	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	680	0	680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	490	300	0	790 CHF	98.15%	775'385.00	0.02	a)
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	0	355	355	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	0	520	520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	695	695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	2'480	795	0	3'275 CHF	98.10%	3'212'775.00	0.07	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	900	535	0	1'435 CHF	97.80%	1'403'430.00	0.03	a)
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	1'810	1'365	0	3'175 CHF	98.55%	3'128'962.50	0.07	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	1'300	2'150	0	3'450 CHF	97.70%	3'370'650.00	0.07	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	4'800	4'990	0	9'790 CHF	97.31%	9'526'649.00	0.21	a)
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	500	500	0	1'000 CHF	97.55%	975'500.00	0.02	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	540	0	0	540 CHF	101.55%	548'370.00	0.01	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	5'850	5'180	0	11'030 CHF	97.11%	10'711'233.00	0.23	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	2'080	500	0	2'580 CHF	95.25%	2'457'450.00	0.05	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMNVX 0 1/2 03/15/29	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'000	1'800	0	3'800 CHF	97.75%	3'714'500.00	0.08	a)
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'870	595	0	2'465 CHF	98.85%	2'436'652.50	0.05	a)
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	220	200	0	420 CHF	99.35%	417'270.00	0.01	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'200	1'000	0	4'200 CHF	96.25%	4'042'500.00	0.09	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	910	0	0	910 CHF	95.80%	871'780.00	0.02	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	3'550	2'640	0	6'190 CHF	96.38%	5'965'922.00	0.13	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	2'050	0	0	2'050 CHF	94.94%	1'946'270.00	0.04	a)
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	0	690	690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	0	610	610	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	700	1'000	0	1'700 CHF	95.70%	1'626'900.00	0.04	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	790	0	0	790 CHF	91.60%	723'640.00	0.02	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'400	0	0	2'400 CHF	94.50%	2'268'000.00	0.05	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	750	600	0	1'350 CHF	89.70%	1'210'950.00	0.03	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	2'050	400	0	2'450 CHF	95.00%	2'327'500.00	0.05	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	1'310	670	0	1'980 CHF	87.10%	1'724'580.00	0.04	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041527	0.0000 % LLBSW 0 09/27/29	0	425	425	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	0	340	340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041592	0.0000 % SOONVX 0 10/11/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041600	0.4000 % SOONVX 0.4 10/11/34	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	40	1'400	0	1'440 CHF	94.65%	1'362'960.00	0.03	a)
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	0	485	0	485 CHF	98.67%	478'549.50	0.01	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
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	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	6'300	2'765	0	9'065 CHF	99.21%	8'993'386.50	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.
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	6'040	2'500	0	8'540 CHF	98.12%	8'379'448.00	0.18	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	610	0	0	610 CHF	98.65%	601'765.00	0.01	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	0	1'245	1'245	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	0	455	455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	0	395	395	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	6'490	3'445	0	9'935 CHF	97.90%	9'726'365.00	0.21	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	3'100	0	0	3'100 CHF	99.54%	3'085'740.00	0.07	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	790	0	0	790 CHF	99.14%	783'206.00	0.02	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	1'530	2'230	0	3'760 CHF	98.76%	3'713'376.00	0.08	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	2'100	1'300	0	3'400 CHF	102.72%	3'492'480.00	0.08	a)
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	600	250	0	850 CHF	102.95%	875'075.00	0.02	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'100	380	0	1'480 CHF	98.00%	1'450'400.00	0.03	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	4'000	3'535	0	7'535 CHF	103.00%	7'761'050.00	0.17	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	16'100	10'740	0	26'840 CHF	95.57%	25'650'988.00	0.56	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	19'100	8'276	0	27'376 CHF	93.28%	25'536'332.80	0.56	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	10'550	6'794	0	17'344 CHF	114.25%	19'815'520.00	0.43	a)
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	1'200	0	0	1'200 CHF	98.85%	1'186'200.00	0.03	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	3'150	3'950	0	7'100 CHF	98.54%	6'996'340.00	0.15	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	3'000	1'650	0	4'650 CHF	99.05%	4'605'825.00	0.10	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	1'100	0	0	1'100 CHF	98.75%	1'086'250.00	0.02	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	870	0	0	870 CHF	98.25%	854'775.00	0.02	a)
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	0	615	615	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'000	0	0	1'000 CHF	98.80%	988'000.00	0.02	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	710	0	0	710 CHF	98.45%	698'995.00	0.02	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	550	200	0	750 CHF	100.95%	757'125.00	0.02	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	2'550	1'125	0	3'675 CHF	98.53%	3'620'977.50	0.08	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	580	0	0	580 CHF	100.90%	585'220.00	0.01	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	800	375	0	1'175 CHF	97.60%	1'146'800.00	0.03	a)
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	100	0	0	100 CHF	97.50%	97'500.00	0.00	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	2'220	1'465	0	3'685 CHF	98.25%	3'620'512.50	0.08	a)
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	600	365	0	965 CHF	98.65%	951'972.50	0.02	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	550	0	0	550 CHF	97.15%	534'325.00	0.01	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	1'950	960	0	2'910 CHF	97.65%	2'841'615.00	0.06	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	250	1'600	0	1'850 CHF	96.85%	1'791'725.00	0.04	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	600	325	0	925 CHF	96.80%	895'400.00	0.02	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	3'780	1'255	0	5'035 CHF	93.67%	4'716'284.50	0.10	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	0	365	0	365 CHF	97.05%	354'232.50	0.01	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	0	900	0	900 CHF	92.65%	833'850.00	0.02	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	70	0	0	70 CHF	87.80%	61'460.00	0.00	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	945	2'200	0	3'145 CHF	89.60%	2'817'920.00	0.06	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'100	730	0	1'830 CHF	90.50%	1'656'150.00	0.04	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	500	0	0	500 CHF	93.90%	469'500.00	0.01	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	0	810	810	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	2'740	755	0	3'495 CHF	93.60%	3'271'320.00	0.07	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	0	605	605	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	2'780	2'300	0	5'080 CHF	93.59%	4'754'372.00	0.10	a)
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	150	0	0	150 CHF	95.15%	142'725.00	0.00	a)
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	0	1'385	1'385	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.
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	1'090	900	0	1'990 CHF	97.30%	1'936'270.00	0.04	a)
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	250	0	0	250 CHF	97.18%	242'950.00	0.01	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	0	305	305	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	0	555	555	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	0	430	0	430 CHF	99.08%	426'044.00	0.01	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	630	2'200	0	2'830 CHF	96.45%	2'729'535.00	0.06	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	3'940	1'150	0	5'090 CHF	96.13%	4'893'017.00	0.11	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	2'340	2'365	0	4'705 CHF	97.40%	4'582'670.00	0.10	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	750	1'080	0	1'830 CHF	95.75%	1'752'225.00	0.04	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	450	0	0	450 CHF	96.15%	432'675.00	0.01	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	2'620	1'300	0	3'920 CHF	96.33%	3'776'136.00	0.08	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	0	3'150	3'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	0	480	480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0477380916	0.2500 % KBFRI 0 1/4 05/24/29	760	1'000	0	1'760 CHF	96.25%	1'694'000.00	0.04	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	1'840	2'455	0	4'295 CHF	94.50%	4'058'775.00	0.09	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	990	0	990	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'400	1'035	0	2'435 CHF	97.30%	2'369'255.00	0.05	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	0	395	395	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	4'360	1'630	0	5'990 CHF	94.85%	5'681'515.00	0.12	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	1'870	2'035	0	3'905 CHF	91.50%	3'573'075.00	0.08	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	950	1'270	0	2'220 CHF	94.85%	2'105'670.00	0.05	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	0	815	815	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180961	0.6250 % ORAFP 0 5/8 06/22/29 EMTN	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	400	0	0	400 CHF	94.60%	378'400.00	0.01	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	1'830	850	0	2'680 CHF	91.95%	2'464'260.00	0.05	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	2'550	3'175	0	5'725 CHF	97.46%	5'579'585.00	0.12	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	4'770	1'800	0	6'570 CHF	92.80%	6'096'960.00	0.13	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	1'150	0	0	1'150 CHF	91.18%	1'048'570.00	0.02	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	3'570	4'150	0	7'720 CHF	78.25%	6'040'900.00	0.13	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	1'000	300	0	1'300 CHF	94.60%	1'229'800.00	0.03	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRI 0.1 11/01/44	1'560	200	0	1'760 CHF	82.10%	1'444'960.00	0.03	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	560	1'115	0	1'675 CHF	97.60%	1'634'800.00	0.04	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	1'750	680	0	2'430 CHF	97.65%	2'372'895.00	0.05	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHPW 0.05 07/19/27 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	760	200	960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	830	180	0	1'010 CHF	94.05%	949'905.00	0.02	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0488506665	0.0000 % SPSNSW 0 02/06/30	0	770	770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734335	0.0000 % SCMNXX 0 08/30/44	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'070	1'000	0	2'070 CHF	76.95%	1'592'865.00	0.03	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	330	250	0	580 CHF	76.70%	444'860.00	0.01	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	355	355	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	0	735	735	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	540	1'050	0	1'590 CHF	83.20%	1'322'880.00	0.03	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	2'630	1'130	0	3'760 CHF	98.60%	3'707'360.00	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.
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0503144393	0.2500 % BFCM 0 1/4 10/24/29 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	0	855	855	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	1'040	0	0	1'040 CHF	97.00%	1'008'800.00	0.02	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	750	1'700	0	2'450 CHF	94.65%	2'318'925.00	0.05	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	1'270	0	0	1'270 CHF	91.60%	1'163'320.00	0.03	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	0	555	555	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	1'580	675	0	2'255 CHF	94.40%	2'128'720.00	0.05	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRI 0 02/26/30	1'570	2'300	0	3'870 CHF	94.25%	3'647'475.00	0.08	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	4'650	3'480	0	8'130 CHF	93.85%	7'630'005.00	0.17	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	1'430	0	0	1'430 CHF	85.25%	1'219'075.00	0.03	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	1'500	1'200	0	2'700 CHF	94.15%	2'542'050.00	0.06	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRI 0.14 06/12/30	2'250	555	0	2'805 CHF	94.60%	2'653'530.00	0.06	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	500	2'200	0	2'700 CHF	96.10%	2'594'700.00	0.06	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	1'650	665	0	2'315 CHF	95.65%	2'214'297.50	0.05	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	800	200	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.02	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRI 0 02/05/31	1'190	900	0	2'090 CHF	92.85%	1'940'565.00	0.04	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	600	400	0	1'000 CHF	98.64%	986'400.00	0.02	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'840	695	0	2'535 CHF	91.20%	2'311'920.00	0.05	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'020	0	1'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	1'450	1'400	0	2'850 CHF	93.97%	2'678'145.00	0.06	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	670	0	0	670 CHF	91.05%	610'035.00	0.01	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	1'000	2'450	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	1'900	2'645	0	4'545 CHF	97.63%	4'437'283.50	0.10	a)
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	2'170	680	0	2'850 CHF	94.35%	2'688'975.00	0.06	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	0	315	315	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	0	340	340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	1'820	600	2'420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	1'550	1'000	0	2'550 CHF	93.10%	2'374'050.00	0.05	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	1'130	550	0	1'680 CHF	91.85%	1'543'080.00	0.03	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBNSW 0 02/14/29	0	700	0	700 CHF	95.10%	665'700.00	0.01	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	0	305	0	305 CHF	95.90%	292'495.00	0.01	a)
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	1'775	1'125	0	2'900 CHF	92.80%	2'691'200.00	0.06	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	560	300	0	860 CHF	94.85%	815'710.00	0.02	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	550	850	0	1'400 CHF	93.75%	1'312'500.00	0.03	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	0	355	355	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	500	0	0	500 CHF	94.25%	471'250.00	0.01	a)
CH0522158960	0.3126 % KBFRI 0.3126 02/02/32	400	2'420	0	2'820 CHF	94.50%	2'664'900.00	0.06	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	1'250	350	0	1'600 CHF	98.10%	1'569'600.00	0.03	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	500	2'700	0	3'200 CHF	110.35%	3'531'200.00	0.08	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	1'600	0	0	1'600 CHF	103.40%	1'654'400.00	0.04	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	4'640	3'510	0	8'150 CHF	96.83%	7'891'645.00	0.17	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	450	0	0	450 CHF	81.20%	365'400.00	0.01	a)
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	3'050	900	0	3'950 CHF	94.89%	3'748'155.00	0.08	a)
CH0528881193	0.2975 % BNS 0.2975 04/03/28 EMTN	500	1'000	0	1'500 CHF	97.50%	1'462'500.00	0.03	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	700	1'650	0	2'350 CHF	98.05%	2'304'175.00	0.05	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	0	580	580	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.
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	5'130	1'540	0	6'670 CHF	93.70%	6'249'790.00	0.14	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	3'245	0	0	3'245 CHF	86.65%	2'811'792.50	0.06	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	1'970	1'720	0	3'690 CHF	97.15%	3'584'835.00	0.08	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	2'480	1'350	0	3'830 CHF	86.90%	3'328'270.00	0.07	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	1'450	3'685	0	5'135 CHF	95.04%	4'880'304.00	0.11	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522	500	860	0	1'360 CHF	88.30%	1'200'880.00	0.03	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	0	1'845	1'845	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	4'860	1'140	0	6'000 CHF	91.20%	5'472'000.00	0.12	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	3'860	4'385	0	8'245 CHF	96.55%	7'960'547.50	0.17	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	2'990	1'440	0	4'430 CHF	90.30%	4'000'290.00	0.09	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	2'550	1'995	0	4'545 CHF	94.51%	4'295'479.50	0.09	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	500	300	0	800 CHF	83.30%	666'400.00	0.01	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	0	200	0	200 CHF	93.30%	186'600.00	0.00	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	2'400	4'235	0	6'635 CHF	97.68%	6'481'068.00	0.14	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	700	1'085	0	1'785 CHF	91.56%	1'634'346.00	0.04	a)
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'150	0	0	1'150 CHF	98.05%	1'127'575.00	0.02	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	3'120	1'000	0	4'120 CHF	97.03%	3'997'636.00	0.09	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	1'885	0	1'885	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	1'150	300	0	1'450 CHF	96.35%	1'397'075.00	0.03	a)
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	650	0	0	650 CHF	92.40%	600'600.00	0.01	a)
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'280	1'620	0	2'900 CHF	96.55%	2'799'950.00	0.06	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	700	405	0	1'105 CHF	94.50%	1'044'225.00	0.02	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	2'270	1'200	0	3'470 CHF	96.30%	3'341'610.00	0.07	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	3'150	1'000	0	4'150 CHF	90.20%	3'743'300.00	0.08	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	1'000	780	0	1'780 CHF	94.90%	1'689'220.00	0.04	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	3'580	2'020	1'500	4'100 CHF	96.80%	3'968'800.00	0.09	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	830	250	0	1'080 CHF	95.95%	1'036'260.00	0.02	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	230	0	0	230 CHF	92.05%	211'715.00	0.00	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	1'640	3'020	0	4'660 CHF	86.76%	4'043'016.00	0.09	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	480	410	0	890 CHF	88.50%	787'650.00	0.02	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	340	0	0	340 CHF	81.95%	278'630.00	0.01	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'390	1'225	0	6'615 CHF	95.19%	6'296'818.50	0.14	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	2'040	0	0	2'040 CHF	87.31%	1'781'124.00	0.04	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	2'000	780	0	2'780 CHF	99.54%	2'767'212.00	0.06	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	0	425	425	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	12'600	7'712	0	20'312 CHF	97.84%	19'873'260.80	0.43	a)
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	9'150	12'238	0	21'388 CHF	113.96%	24'373'764.80	0.53	a)
CH0557778963	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33 MAR	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778989	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 APR	0	2'050	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778997	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 APR	0	1'550	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779003	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47	0	9'565	0	9'565 CHF	108.80%	10'406'720.00	0.23	a)
CH0557779011	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 10JU	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779029	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 19JU	0	1'350	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779037	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 5JL	0	1'950	1'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779045	0.8750 % SWISS 0 7/8 05/22/47 22JU	0	1'450	1'450	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.
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	0	2'020	2'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	0	370	370	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	520	810	0	1'330 CHF	74.85%	995'505.00	0.02	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	2'970	1'315	0	4'285 CHF	86.02%	3'685'957.00	0.08	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	750	1'000	0	1'750 CHF	94.40%	1'652'000.00	0.04	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	2'950	1'275	900	3'325 CHF	95.05%	3'160'412.50	0.07	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	0	1'600	0	1'600 CHF	93.35%	1'493'600.00	0.03	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	480	1'100	0	1'580 CHF	86.80%	1'371'440.00	0.03	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	1'130	1'605	0	2'735 CHF	95.55%	2'613'292.50	0.06	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	1'120	650	0	1'770 CHF	92.80%	1'642'560.00	0.04	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	1'495	750	0	2'245 CHF	95.80%	2'150'710.00	0.05	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	780	0	780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'030	545	0	1'575 CHF	91.75%	1'445'062.50	0.03	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	6'250	2'290	0	8'540 CHF	94.83%	8'098'482.00	0.18	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	240	200	0	440 CHF	90.90%	399'960.00	0.01	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	500	3'500	0	4'000 CHF	99.13%	3'965'200.00	0.09	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	1'850	1'370	0	3'220 CHF	92.18%	2'968'196.00	0.06	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899091	0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	3'950	1'160	0	5'110 CHF	95.24%	4'866'764.00	0.11	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	3'690	1'690	0	5'380 CHF	92.96%	5'001'248.00	0.11	a)
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	560	400	0	960 CHF	77.60%	744'960.00	0.02	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	670	150	0	820 CHF	93.30%	765'060.00	0.02	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	870	200	0	1'070 CHF	72.40%	774'680.00	0.02	a)
CH0580291968	0.2450 % SCMNXX 0.245 11/20/34	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0580464698	1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	0	1'935	1'935	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	4'765	1'455	0	6'220 CHF	91.10%	5'666'420.00	0.12	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	4'200	2'260	0	6'460 CHF	95.95%	6'198'370.00	0.14	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	1'650	1'110	0	2'760 CHF	91.51%	2'525'676.00	0.06	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	2'580	1'960	0	4'540 CHF	88.55%	4'020'170.00	0.09	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	2'200	2'205	0	4'405 CHF	93.84%	4'133'652.00	0.09	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	730	955	0	1'685 CHF	90.77%	1'529'474.50	0.03	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	1'350	2'830	0	4'180 CHF	83.75%	3'500'750.00	0.08	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	600	200	0	800 CHF	96.10%	768'800.00	0.02	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	650	500	0	1'150 CHF	97.40%	1'120'100.00	0.02	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	1'050	590	0	1'640 CHF	90.25%	1'480'100.00	0.03	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	700	0	0	700 CHF	90.90%	636'300.00	0.01	a)
CH0593093211	0.1250 % KWOPER 0 1/8 02/21/31	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	1'410	0	0	1'410 CHF	92.67%	1'306'647.00	0.03	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	850	0	0	850 CHF	87.41%	742'985.00	0.02	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'060	980	0	2'040 CHF	83.50%	1'703'400.00	0.04	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	560	725	0	1'285 CHF	85.90%	1'103'815.00	0.02	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	0	1'240	1'240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	0	295	295	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	0	360	360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	4'180	3'385	0	7'565 CHF	94.61%	7'157'246.50	0.16	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	1'350	1'735	1'000	2'085 CHF	93.20%	1'943'220.00	0.04	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	750	1'140	0	1'890 CHF	94.80%	1'791'720.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	1'100	800	0	1'900 CHF	98.75%	1'876'250.00	0.04	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	1'190	645	0	1'835 CHF	86.85%	1'593'697.50	0.03	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	2'670	505	0	3'175 CHF	94.15%	2'989'262.50	0.07	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	500	1'300	0	1'800 CHF	91.00%	1'638'000.00	0.04	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	5'500	4'765	0	10'265 CHF	96.84%	9'940'626.00	0.22	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	2'700	0	0	2'700 CHF	93.19%	2'516'130.00	0.05	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	2'050	0	0	2'050 CHF	91.15%	1'868'575.00	0.04	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	0	605	605	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	2'970	750	0	3'720 CHF	93.10%	3'463'320.00	0.08	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	0	940	0	940 CHF	93.90%	882'660.00	0.02	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	900	0	0	900 CHF	94.80%	853'200.00	0.02	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	855	855	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	3'040	1'090	350	3'780 CHF	94.10%	3'556'980.00	0.08	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	4'745	3'490	0	8'235 CHF	94.35%	7'769'722.50	0.17	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	2'270	2'275	0	4'545 CHF	91.10%	4'140'495.00	0.09	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	1'890	805	0	2'695 CHF	89.53%	2'412'833.50	0.05	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	440	0	0	440 CHF	93.30%	410'520.00	0.01	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBNWS 0.1 04/18/31	0	750	0	750 CHF	93.05%	697'875.00	0.02	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	350	0	0	350 CHF	92.05%	322'175.00	0.01	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	0	945	945	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	880	520	0	1'400 CHF	95.20%	1'332'800.00	0.03	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	0	1'120	1'120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	0	340	340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112455766	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33	0	585	585	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112940601	0.0500 % NIDKBK 0.05 05/27/31	2'990	200	0	3'190 CHF	92.75%	2'958'725.00	0.06	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	2'910	585	0	3'495 CHF	92.50%	3'232'875.00	0.07	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	830	0	830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	100	0	0	100 CHF	93.90%	93'900.00	0.00	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	0	1'020	1'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	2'700	1'995	0	4'695 CHF	93.18%	4'374'801.00	0.10	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	0	1'550	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223499	0.3000 % KSSTGA 0.3 09/30/36	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	920	920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	0	270	270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	630	630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	1'000	375	0	1'375 CHF	93.35%	1'283'562.50	0.03	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	0	515	515	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	0	645	645	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	2'500	500	0	3'000 CHF	97.08%	2'912'400.00	0.06	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	1'400	0	0	1'400 CHF	87.50%	1'225'000.00	0.03	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	630	0	0	630 CHF	87.80%	553'140.00	0.01	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	450	1'225	0	1'675 CHF	86.05%	1'441'337.50	0.03	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053794	0.1250 % WKBNWS 0 1/8 09/15/33	0	450	0	450 CHF	90.45%	407'025.00	0.01	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	0	1'430	1'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053828	0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40	0	170	170	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.
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	490	1'295	0	1'785 CHF	90.10%	1'608'285.00	0.04	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	4'470	2'500	0	6'970 CHF	93.29%	6'502'313.00	0.14	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'290	500	0	2'790 CHF	87.95%	2'453'805.00	0.05	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	0	525	525	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	1'575	0	0	1'575 CHF	93.50%	1'472'625.00	0.03	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	400	0	0	400 CHF	93.90%	375'600.00	0.01	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	1'270	0	0	1'270 CHF	91.40%	1'160'780.00	0.03	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	0	460	460	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	750	0	0	750 CHF	92.60%	694'500.00	0.02	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	1'980	0	0	1'980 CHF	94.20%	1'865'160.00	0.04	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	3'050	0	0	3'050 CHF	91.02%	2'776'110.00	0.06	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	0	1'245	1'245	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	0	485	485	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	0	1'245	1'245	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	1'035	350	0	1'385 CHF	95.90%	1'328'215.00	0.03	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	0	1'245	1'245	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	1'830	1'695	0	3'525 CHF	95.75%	3'375'187.50	0.07	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	0	375	375	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	0	610	610	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	665	665	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	300	300	0	600 CHF	95.45%	572'700.00	0.01	a)
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	0	930	0	930 CHF	93.25%	867'225.00	0.02	a)
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	0	430	430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	1'900	2'200	0	4'100 CHF	97.80%	4'009'800.00	0.09	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	0	685	685	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	650	900	0	1'550 CHF	85.60%	1'326'800.00	0.03	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	1'710	700	0	2'410 CHF	92.85%	2'237'685.00	0.05	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	1'075	1'000	2'075	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	0	520	0	520 CHF	95.20%	495'040.00	0.01	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	550	300	0	850 CHF	86.30%	733'550.00	0.02	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	0	310	310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	2'320	600	0	2'920 CHF	94.57%	2'761'444.00	0.06	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	0	360	360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	0	880	880	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	665	500	0	1'165 CHF	96.66%	1'126'089.00	0.02	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	0	320	320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266245	0.3000 % WKBSNW 0.3 02/07/30	0	250	0	250 CHF	95.45%	238'625.00	0.01	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	0	575	575	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	1'150	0	0	1'150 CHF	95.35%	1'096'525.00	0.02	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	650	415	0	1'065 CHF	93.90%	1'000'035.00	0.02	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	94.50%	1'606'500.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	0	1'450	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	3'100	1'765	0	4'865 CHF	94.25%	4'585'262.50	0.10	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	1'600	1'805	0	3'405 CHF	95.10%	3'238'155.00	0.07	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	1'320	0	0	1'320 CHF	95.05%	1'254'660.00	0.03	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	550	0	0	550 CHF	90.55%	498'025.00	0.01	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	1'650	2'370	0	4'020 CHF	98.34%	3'953'268.00	0.09	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	2'500	990	0	3'490 CHF	97.63%	3'407'287.00	0.07	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	600	0	0	600 CHF	96.50%	579'000.00	0.01	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	900	1'150	0	2'050 CHF	93.35%	1'913'675.00	0.04	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	4'630	3'330	0	7'960 CHF	93.87%	7'472'052.00	0.16	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	1'000	0	0	1'000 CHF	96.46%	964'600.00	0.02	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'060	3'670	0	5'730 CHF	91.80%	5'260'140.00	0.11	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	0	690	690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	1'900	1'100	0	3'000 CHF	97.75%	2'932'500.00	0.06	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	0	330	330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	0	405	405	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	0	495	495	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	0	940	940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	500	0	0	500 CHF	96.25%	481'250.00	0.01	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	2'650	300	0	2'950 CHF	98.44%	2'903'980.00	0.06	a)
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	0	595	595	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	950	0	0	950 CHF	97.70%	928'150.00	0.02	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	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	1'300	0	0	1'300 CHF	98.32%	1'278'160.00	0.03	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	1'250	750	0	2'000 CHF	96.65%	1'933'000.00	0.04	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	610	500	0	1'110 CHF	98.40%	1'092'240.00	0.02	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	540	1'500	0	2'040 CHF	93.10%	1'899'240.00	0.04	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	1'800	425	0	2'225 CHF	98.20%	2'184'950.00	0.05	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	1'500	590	0	2'090 CHF	97.15%	2'030'435.00	0.04	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	900	1'240	0	2'140 CHF	98.71%	2'112'394.00	0.05	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	1'650	620	0	2'270 CHF	98.89%	2'244'803.00	0.05	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	2'180	0	0	2'180 CHF	99.13%	2'161'034.00	0.05	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	0	1'365	1'365	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	2'795	255	0	3'050 CHF	101.10%	3'083'550.00	0.07	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	1'850	695	0	2'545 CHF	100.60%	2'560'270.00	0.06	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	3'700	2'340	0	6'040 CHF	103.00%	6'221'200.00	0.14	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	1'800	1'205	0	3'005 CHF	106.83%	3'210'241.50	0.07	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	650	0	0	650 CHF	98.35%	639'275.00	0.01	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	1'300	860	0	2'160 CHF	98.75%	2'133'000.00	0.05	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	1'450	350	0	1'800 CHF	98.75%	1'777'500.00	0.04	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	2'550	1'850	0	4'400 CHF	100.22%	4'409'680.00	0.10	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	1'000	1'450	0	2'450 CHF	104.05%	2'549'225.00	0.06	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'000	1'405	0	2'405 CHF	98.55%	2'370'127.50	0.05	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	550	1'415	0	1'965 CHF	98.95%	1'944'367.50	0.04	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	0	415	415	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	4'325	1'000	0	5'325 CHF	99.60%	5'303'700.00	0.12	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	700	0	700	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.
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	800	0	0	800 CHF	98.70%	789'600.00	0.02	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	3'150	1'485	1'500	3'135 CHF	99.40%	3'116'190.00	0.07	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	99.60%	1'494'000.00	0.03	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	1'300	1'300	0	2'600 CHF	99.80%	2'594'800.00	0.06	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	1'150	1'320	0	2'470 CHF	100.95%	2'493'465.00	0.05	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	1'300	395	0	1'695 CHF	101.75%	1'724'662.50	0.04	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	4'900	3'190	0	8'090 CHF	102.74%	8'311'666.00	0.18	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	3'265	0	0	3'265 CHF	107.11%	3'497'141.50	0.08	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1182086848	1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	0	2'840	2'840	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	695	695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	800	360	0	1'160 CHF	99.20%	1'150'720.00	0.03	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	0	1'455	1'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	0	485	485	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	0	360	360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	1'920	800	2'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	1'100	1'300	0	2'400 CHF	101.30%	2'431'200.00	0.05	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217768	1.7000 % KTSPLB 1.7 06/24/32	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	0	270	270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	6'200	1'830	1'000	7'030 CHF	102.84%	7'229'652.00	0.16	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	4'700	945	0	5'645 CHF	105.35%	5'947'007.50	0.13	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	2'800	2'850	0	5'650 CHF	114.45%	6'466'425.00	0.14	a)
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	1'850	900	0	2'750 CHF	127.75%	3'513'125.00	0.08	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	1'300	500	0	1'800 CHF	102.69%	1'848'420.00	0.04	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	5'610	2'035	0	7'645 CHF	105.08%	8'033'366.00	0.18	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	2'920	1'600	0	4'520 CHF	108.09%	4'885'668.00	0.11	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	1'000	1'045	0	2'045 CHF	102.00%	2'085'900.00	0.05	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	3'900	4'575	0	8'475 CHF	104.16%	8'827'560.00	0.19	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	1'465	500	0	1'965 CHF	116.50%	2'289'225.00	0.05	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	400	0	0	400 CHF	100.65%	402'600.00	0.01	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	1'900	0	0	1'900 CHF	102.90%	1'955'100.00	0.04	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	1'150	1'600	0	2'750 CHF	103.40%	2'843'500.00	0.06	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	1'050	940	0	1'990 CHF	102.15%	2'032'785.00	0.04	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	690	650	0	1'340 CHF	101.95%	1'366'130.00	0.03	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	1'150	1'000	0	2'150 CHF	108.15%	2'325'225.00	0.05	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	950	350	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	3'300	0	0	3'300 CHF	108.80%	3'590'400.00	0.08	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	6'000	1'125	0	7'125 CHF	115.67%	8'241'487.50	0.18	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	3'240	2'230	0	5'470 CHF	131.98%	7'219'306.00	0.16	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	1'050	1'130	500	1'680 CHF	101.30%	1'701'840.00	0.04	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	0	1'305	1'305	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.
CH1194355116	2.1250 % NESNVX 2 1/8 07/15/30	0	2'620	2'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	0	1'305	1'305	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	100.60%	1'207'200.00	0.03	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	410	300	0	710 CHF	111.05%	788'455.00	0.02	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	1'850	475	0	2'325 CHF	102.05%	2'372'662.50	0.05	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	595	0	0	595 CHF	124.70%	741'965.00	0.02	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'050	1'565	0	2'615 CHF	99.87%	2'611'600.50	0.06	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	1'150	820	0	1'970 CHF	102.35%	2'016'295.00	0.04	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	1'445	0	0	1'445 CHF	109.75%	1'585'887.50	0.03	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	1'100	960	0	2'060 CHF	99.83%	2'056'498.00	0.04	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	2'400	900	0	3'300 CHF	110.23%	3'637'590.00	0.08	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	400	150	0	550 CHF	101.00%	555'500.00	0.01	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	1'650	1'405	0	3'055 CHF	102.50%	3'131'375.00	0.07	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	1'300	545	0	1'845 CHF	99.85%	1'842'232.50	0.04	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	0	1'135	1'135	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	1'440	475	0	1'915 CHF	99.87%	1'912'510.50	0.04	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	1'030	705	0	1'735 CHF	101.15%	1'754'952.50	0.04	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	4'430	0	0	4'430 CHF	102.79%	4'553'597.00	0.10	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	3'200	0	0	3'200 CHF	107.85%	3'451'200.00	0.08	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	0	700	0	700 CHF	100.65%	704'550.00	0.02	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'000	400	0	1'400 CHF	99.95%	1'399'300.00	0.03	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	0	595	595	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	1'100	835	0	1'935 CHF	100.30%	1'940'805.00	0.04	a)
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	1'200	590	0	1'790 CHF	104.85%	1'876'815.00	0.04	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	1'600	2'485	0	4'085 CHF	102.53%	4'188'350.50	0.09	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	3'200	1'985	0	5'185 CHF	109.29%	5'666'686.50	0.12	a)
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367471	2.5500 % GROUPE 2.55 09/30/32	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	0	630	630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	2'100	2'000	0	4'100 CHF	106.44%	4'364'040.00	0.10	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	1'250	0	0	1'250 CHF	111.05%	1'388'125.00	0.03	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	650	200	0	850 CHF	101.27%	860'795.00	0.02	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	2'250	3'730	0	5'980 CHF	101.11%	6'046'378.00	0.13	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	3'000	2'615	0	5'615 CHF	106.74%	5'993'451.00	0.13	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	3'260	2'645	0	5'905 CHF	116.02%	6'850'981.00	0.15	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	1'900	2'745	0	4'645 CHF	102.75%	4'772'737.50	0.10	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	2'690	800	0	3'490 CHF	103.65%	3'617'385.00	0.08	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	600	700	0	1'300 CHF	101.00%	1'313'000.00	0.03	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	900	0	0	900 CHF	102.50%	922'500.00	0.02	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	0	735	735	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	600	435	0	1'035 CHF	101.50%	1'050'525.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	300	1'985	0	2'285 CHF	105.45%	2'409'532.50	0.05	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	1'430	0	0	1'430 CHF	103.75%	1'483'625.00	0.03	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'000	200	0	1'200 CHF	101.50%	1'218'000.00	0.03	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	1'180	0	0	1'180 CHF	107.85%	1'272'630.00	0.03	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	400	230	0	630 CHF	105.00%	661'500.00	0.01	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	1'000	255	0	1'255 CHF	101.10%	1'268'805.00	0.03	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	1'300	360	0	1'660 CHF	103.85%	1'723'910.00	0.04	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	4'760	560	0	5'320 CHF	109.03%	5'800'396.00	0.13	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'080	0	600	480 CHF	103.10%	494'880.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	650	475	0	1'125 CHF	101.13%	1'137'712.50	0.02	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	750	905	0	1'655 CHF	104.15%	1'723'682.50	0.04	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	1'050	285	0	1'335 CHF	102.35%	1'366'372.50	0.03	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	345	1'350	0	1'695 CHF	128.05%	2'170'447.50	0.05	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	1'440	1'045	0	2'485 CHF	104.05%	2'585'642.50	0.06	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	2'250	500	0	2'750 CHF	107.50%	2'956'250.00	0.06	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	2'650	1'130	0	3'780 CHF	108.56%	4'103'568.00	0.09	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	3'400	2'775	0	6'175 CHF	114.27%	7'056'172.50	0.15	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	1'330	150	0	1'480 CHF	107.65%	1'593'220.00	0.03	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	1'850	580	0	2'430 CHF	102.90%	2'500'470.00	0.05	a)
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	0	1'230	1'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	280	500	0	780 CHF	144.65%	1'128'270.00	0.02	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	1'235	425	0	1'660 CHF	113.65%	1'886'590.00	0.04	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	690	690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	0	680	680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937708	2.5025 % EOANGR 2.5025 12/05/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	2'700	705	0	3'405 CHF	104.30%	3'551'415.00	0.08	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	950	240	0	1'190 CHF	104.90%	1'248'310.00	0.03	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	1'250	670	0	1'920 CHF	100.60%	1'931'520.00	0.04	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	0	525	525	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	1'150	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	1'500	1'385	0	2'885 CHF	101.40%	2'925'390.00	0.06	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	0	480	480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	1'500	850	800	1'550 CHF	105.25%	1'631'375.00	0.04	a)
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	400	450	0	850 CHF	106.85%	908'225.00	0.02	a)
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	1'400	200	0	1'600 CHF	103.55%	1'656'800.00	0.04	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	400	650	0	1'050 CHF	102.50%	1'076'250.00	0.02	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	750	250	0	1'000 CHF	99.90%	999'000.00	0.02	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	495	2'900	0	3'395 CHF	101.49%	3'445'585.50	0.08	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	2'150	5'215	0	7'365 CHF	104.41%	7'689'796.50	0.17	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	2'050	1'065	0	3'115 CHF	107.19%	3'338'968.50	0.07	a)
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	0	1'550	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	500	0	0	500 CHF	109.60%	548'000.00	0.01	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBNSW 2.05 07/24/28	0	1'310	0	1'310 CHF	103.75%	1'359'125.00	0.03	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	720	2'245	0	2'965 CHF	108.65%	3'221'472.50	0.07	a)
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	550	500	0	1'050 CHF	103.25%	1'084'125.00	0.02	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	1'000	250	0	1'250 CHF	104.65%	1'308'125.00	0.03	a)
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	1'500	1'150	0	2'650 CHF	104.60%	2'771'900.00	0.06	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	1'100	705	0	1'805 CHF	101.02%	1'823'411.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	1'750	140	0	1'890 CHF	105.20%	1'988'280.00	0.04	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOKB 2.4875 01/25/29 GMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	1'650	700	0	2'350 CHF	110.58%	2'598'630.00	0.06	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	850	150	0	1'000 CHF	123.75%	1'237'500.00	0.03	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	530	0	0	530 CHF	100.35%	531'855.00	0.01	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	2'985	800	0	3'785 CHF	113.92%	4'311'872.00	0.09	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	650	1'450	0	2'100 CHF	137.60%	2'889'600.00	0.06	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	2'450	2'605	0	5'055 CHF	105.41%	5'328'475.50	0.12	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	2'905	945	0	3'850 CHF	107.82%	4'151'070.00	0.09	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	3'860	0	0	3'860 CHF	110.51%	4'265'686.00	0.09	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	2'365	0	0	2'365 CHF	104.90%	2'480'885.00	0.05	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	1'300	300	0	1'600 CHF	104.00%	1'664'000.00	0.04	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	4'350	1'000	0	5'350 CHF	103.64%	5'544'740.00	0.12	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	3'370	1'155	0	4'525 CHF	106.99%	4'841'297.50	0.11	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'800	600	750	1'650 CHF	104.05%	1'716'825.00	0.04	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	800	755	0	1'555 CHF	100.66%	1'565'263.00	0.03	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	0	1'055	1'055	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	1'750	755	0	2'505 CHF	102.50%	2'567'625.00	0.06	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	560	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	700	625	0	1'325 CHF	101.10%	1'339'575.00	0.03	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	0	975	975	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	0	565	565	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	1'300	1'300	0	2'600 CHF	105.25%	2'736'500.00	0.06	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLILJ 2.35 03/01/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651945	2.7500 % KWLILJ 2 3/4 03/01/30	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	1'950	1'650	0	3'600 CHF	105.60%	3'801'600.00	0.08	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	0	1'845	1'845	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	0	665	665	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	1'050	0	0	1'050 CHF	100.97%	1'060'185.00	0.02	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	550	300	0	850 CHF	102.55%	871'675.00	0.02	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	700	0	0	700 CHF	104.33%	730'310.00	0.02	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	1'450	0	0	1'450 CHF	102.85%	1'491'325.00	0.03	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	555	555	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	1'200	265	0	1'465 CHF	102.65%	1'503'822.50	0.03	a)
CH1244731753	2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1248666930	1.8750 % SCMNVS 1 7/8 08/23/30	0	1'625	1'625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	0	505	505	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	1'200	200	0	1'400 CHF	104.35%	1'460'900.00	0.03	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	2'250	1'225	0	3'475 CHF	107.90%	3'749'525.00	0.08	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	1'300	765	0	2'065 CHF	102.20%	2'110'430.00	0.05	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	2'600	3'855	0	6'455 CHF	106.96%	6'904'268.00	0.15	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	3'500	1'915	0	5'415 CHF	111.17%	6'019'855.50	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.
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	565	565	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416087	2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32	0	2'050	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	1'800	1'705	0	3'505 CHF	103.00%	3'610'150.00	0.08	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	0	580	580	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	1'455	1'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	2'250	190	0	2'440 CHF	103.85%	2'533'940.00	0.06	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	0	625	625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	545	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	3'050	1'040	0	4'090 CHF	108.01%	4'417'609.00	0.10	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	4'625	3'055	0	7'680 CHF	111.90%	8'593'920.00	0.19	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	1'550	855	400	2'005 CHF	105.00%	2'105'250.00	0.05	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	2'350	0	0	2'350 CHF	101.35%	2'381'725.00	0.05	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	1'150	450	0	1'600 CHF	103.35%	1'653'600.00	0.04	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	900	0	0	900 CHF	106.00%	954'000.00	0.02	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	1'000	1'190	0	2'190 CHF	103.35%	2'263'365.00	0.05	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	2'300	640	0	2'940 CHF	103.75%	3'050'250.00	0.07	a)
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	2'000	1'590	0	3'590 CHF	101.60%	3'647'440.00	0.08	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	2'550	570	0	3'120 CHF	105.65%	3'296'280.00	0.07	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	1'090	1'090	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	660	450	0	1'110 CHF	108.50%	1'204'350.00	0.03	a)
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	2'800	380	0	3'180 CHF	104.45%	3'321'510.00	0.07	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	650	1'100	0	1'750 CHF	100.75%	1'763'125.00	0.04	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	1'300	2'295	0	3'595 CHF	103.45%	3'719'027.50	0.08	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	550	700	0	1'250 CHF	101.80%	1'272'500.00	0.03	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	1'150	600	0	1'750 CHF	115.70%	2'024'750.00	0.04	a)
CH1265890801	1.6000 % KBBS 1.6 06/24/31 004	0	900	0	900 CHF	103.50%	931'500.00	0.02	a)
CH1265890827	1.6000 % KBBS 1.6 06/28/44 005	0	1'420	0	1'420 CHF	109.70%	1'557'740.00	0.03	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	460	200	0	660 CHF	153.25%	1'011'450.00	0.02	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	560	0	0	560 CHF	102.92%	576'352.00	0.01	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	0	380	380	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	3'200	2'925	0	6'125 CHF	105.63%	6'469'837.50	0.14	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	3'050	1'980	0	5'030 CHF	110.18%	5'542'054.00	0.12	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	850	635	0	1'485 CHF	101.35%	1'505'047.50	0.03	a)
CH1266847255	1.8000 % WKBSW 1.8 08/29/29	0	1'655	0	1'655 CHF	103.85%	1'718'717.50	0.04	a)
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	2'350	775	0	3'125 CHF	104.16%	3'255'000.00	0.07	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	4'100	1'835	0	5'935 CHF	107.07%	6'354'604.50	0.14	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	2'650	1'350	0	4'000 CHF	110.49%	4'419'600.00	0.10	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	1'850	680	0	2'530 CHF	102.95%	2'604'635.00	0.06	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	2'200	695	0	2'895 CHF	102.75%	2'974'612.50	0.06	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	600	600	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.
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	0	1'000	0	1'000 CHF	103.25%	1'032'500.00	0.02	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBNK 2.05 09/26/28	390	500	0	890 CHF	103.00%	916'700.00	0.02	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	1'950	715	0	2'665 CHF	105.50%	2'811'575.00	0.06	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	1'050	1'210	0	2'260 CHF	107.70%	2'434'020.00	0.05	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	350	685	0	1'035 CHF	102.45%	1'060'357.50	0.02	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	1'850	1'080	0	2'930 CHF	104.15%	3'051'595.00	0.07	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	700	350	0	1'050 CHF	104.90%	1'101'450.00	0.02	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	1'000	2'200	0	3'200 CHF	105.60%	3'379'200.00	0.07	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	1'150	200	0	1'350 CHF	103.40%	1'395'900.00	0.03	a)
CH1271360617	1.2125 % EBRD 1.2125 03/04/31 EMTN	1'100	485	0	1'585 CHF	102.65%	1'627'002.50	0.04	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	605	605	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	0	585	585	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	2'900	1'250	1'000	3'150 CHF	105.30%	3'316'950.00	0.07	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	0	1'145	1'145	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	1'910	1'910	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	250	200	0	450 CHF	101.50%	456'750.00	0.01	a)
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	1'150	0	500	650 CHF	104.50%	679'250.00	0.01	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	780	780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	0	930	930	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269748	3.0000 % CRNBNK 3 07/14/25	0	260	260	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269755	2.7325 % SANSFC 2.7325 07/04/25 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269763	2.9325 % SANSFC 2.9325 07/04/28 EMTN	0	865	865	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	4'880	575	0	5'455 CHF	114.01%	6'219'245.50	0.14	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	2'800	3'315	0	6'115 CHF	120.65%	7'377'747.50	0.16	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	0	500	0	500 CHF	101.95%	509'750.00	0.01	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	1'000	8'230	0	9'230 CHF	106.21%	9'803'183.00	0.21	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	1'320	1'000	0	2'320 CHF	108.82%	2'524'624.00	0.06	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'800	410	0	3'210 CHF	106.70%	3'425'070.00	0.07	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	0	1'150	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	1'100	500	0	1'600 CHF	104.15%	1'666'400.00	0.04	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	1'300	400	0	1'700 CHF	107.05%	1'819'850.00	0.04	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	0	585	585	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	1'450	500	0	1'950 CHF	103.40%	2'016'300.00	0.04	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	900	100	0	1'000 CHF	108.85%	1'088'500.00	0.02	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	1'300	940	0	2'240 CHF	104.60%	2'343'040.00	0.05	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	102.20%	1'226'400.00	0.03	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	1'230	800	0	2'030 CHF	114.75%	2'329'425.00	0.05	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	1'830	0	1'830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	4'400	3'785	0	8'185 CHF	113.21%	9'266'238.50	0.20	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	1'200	0	0	1'200 CHF	106.42%	1'277'040.00	0.03	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	1'500	1'300	0	2'800 CHF	116.85%	3'271'800.00	0.07	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	700	340	0	1'040 CHF	105.30%	1'095'120.00	0.02	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	2'700	1'155	0	3'855 CHF	102.55%	3'953'302.50	0.09	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	2'655	2'655	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	0	990	990	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	0	300	300	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.
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	1'000	250	0	1'250 CHF	137.55%	1'719'375.00	0.04	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	1'130	1'130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	2'300	1'380	0	3'680 CHF	113.50%	4'176'800.00	0.09	a)
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	1'600	500	0	2'100 CHF	106.57%	2'237'970.00	0.05	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	1'650	1'150	0	2'800 CHF	110.41%	3'091'480.00	0.07	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222509	1.7000 % TESSIN 1.7 10/31/33	1'400	475	0	1'875 CHF	107.55%	2'016'562.50	0.04	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	1'000	1'315	0	2'315 CHF	102.65%	2'376'347.50	0.05	a)
CH1290222541	2.4000 % AMALEA 2.4 11/22/30	900	1'050	500	1'450 CHF	106.05%	1'537'725.00	0.03	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	565	565	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	1'400	700	0	2'100 CHF	101.95%	2'140'950.00	0.05	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	1'500	525	0	2'025 CHF	104.55%	2'117'137.50	0.05	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	705	705	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	215	0	215 CHF	100.85%	216'827.50	0.00	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	670	965	0	1'635 CHF	104.70%	1'711'845.00	0.04	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	1'245	1'245	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871024	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 EMTN	800	2'200	0	3'000 CHF	103.50%	3'105'000.00	0.07	a)
CH1290871032	1.3475 % TPNZ 1.3475 03/21/31 EMTN	0	2'470	0	2'470 CHF	102.25%	2'525'575.00	0.06	a)
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	2'520	0	2'520 CHF	103.40%	2'605'680.00	0.06	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRIB 1.9 09/08/26	750	500	0	1'250 CHF	101.70%	1'271'250.00	0.03	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	600	495	0	1'095 CHF	103.50%	1'133'325.00	0.02	a)
CH1290991327	1.1250 % KBBL 1 1/8 08/29/34	0	1'650	0	1'650 CHF	100.05%	1'650'825.00	0.04	a)
CH1290991335	1.0200 % KBBL 1.02 09/19/44	0	1'200	0	1'200 CHF	99.48%	1'193'796.00	0.03	a)
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	0	565	0	565 CHF	101.10%	571'215.00	0.01	a)
CH1291601941	1.5200 % ACANXB 1.52 03/25/33	0	1'760	900	860 CHF	102.40%	880'640.00	0.02	a)
CH1291601966	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28 MAY	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	0	490	490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291809916	2.5500 % EDF 2.55 09/12/31 EMTN	0	270	270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	850	310	0	1'160 CHF	103.05%	1'195'380.00	0.03	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	1'400	565	0	1'965 CHF	102.00%	2'004'300.00	0.04	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	700	770	0	1'470 CHF	104.70%	1'539'090.00	0.03	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	0	275	275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	825	825	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714361	2.3750 % INSBER 2 3/8 09/29/31	0	1'330	1'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	315	315	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	1'100	400	0	1'500 CHF	103.95%	1'559'250.00	0.03	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	390	390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	1'100	340	300	1'140 CHF	101.65%	1'158'810.00	0.03	a)
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	650	300	0	950 CHF	104.70%	994'650.00	0.02	a)
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296276160	2.7475 % ACHMEA 2.7475 10/16/30 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	1'105	1'105	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	0	390	390	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.
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	1'750	1'055	0	2'805 CHF	101.50%	2'847'075.00	0.06	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	3'050	1'900	0	4'950 CHF	107.45%	5'318'775.00	0.12	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	1'300	585	0	1'885 CHF	103.70%	1'954'745.00	0.04	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	2'100	0	0	2'100 CHF	112.65%	2'365'650.00	0.05	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	0	435	435	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	0	525	525	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277840	1.8750 % NESNVX 1 7/8 11/20/31	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	0	595	595	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277899	2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	750	700	0	1'450 CHF	105.05%	1'523'225.00	0.03	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	0	465	465	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	455	455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916749	1.5600 % AUCCKN 1.56 11/30/29 EMTN	450	325	0	775 CHF	103.25%	800'187.50	0.02	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	1'950	1'020	0	2'970 CHF	109.05%	3'238'785.00	0.07	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	385	385	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	1'000	715	0	1'715 CHF	101.90%	1'747'585.00	0.04	a)
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	1'350	800	0	2'150 CHF	105.50%	2'268'250.00	0.05	a)
CH1306117073	1.4500 % ZURICH 1.45 12/01/34	800	730	0	1'530 CHF	106.45%	1'628'685.00	0.04	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	250	3'300	0	3'550 CHF	101.51%	3'603'605.00	0.08	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	1'600	2'880	0	4'480 CHF	102.87%	4'608'576.00	0.10	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	650	1'150	0	1'800 CHF	105.02%	1'890'360.00	0.04	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117149	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/34	75	0	0	75 CHF	104.20%	78'150.00	0.00	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	1'560	0	0	1'560 CHF	108.90%	1'698'840.00	0.04	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	500	350	0	850 CHF	115.40%	980'900.00	0.02	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	2'350	1'800	0	4'150 CHF	105.39%	4'373'685.00	0.10	a)
CH1310346247	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 12/21/38 749	900	540	0	1'440 CHF	107.34%	1'545'696.00	0.03	a)
CH1310346262	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 05/28/30 751	0	2'810	0	2'810 CHF	101.65%	2'856'365.00	0.06	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346296	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 MAR	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346304	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 03/25/33	0	1'450	0	1'450 CHF	103.55%	1'501'475.00	0.03	a)
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	2'380	0	2'380 CHF	108.75%	2'588'250.00	0.06	a)
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	650	0	0	650 CHF	103.90%	675'350.00	0.01	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	1'150	595	0	1'745 CHF	101.60%	1'772'920.00	0.04	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	900	410	0	1'310 CHF	103.70%	1'358'470.00	0.03	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	1'200	500	0	1'700 CHF	103.34%	1'756'780.00	0.04	a)
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	2'650	1'085	0	3'735 CHF	104.49%	3'902'701.50	0.09	a)
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	770	1'350	0	2'120 CHF	106.86%	2'265'432.00	0.05	a)
CH1319968447	1.2000 % ZURICH 1.2 03/07/30	1'350	955	0	2'305 CHF	102.55%	2'363'777.50	0.05	a)
CH1319968462	1.4150 % LUGANO 1.415 03/07/34	700	635	0	1'335 CHF	104.45%	1'394'407.50	0.03	a)
CH1319968512	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 MAR	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	2'400	1'935	0	4'335 CHF	103.42%	4'483'257.00	0.10	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	1'360	4'000	0	5'360 CHF	104.82%	5'618'352.00	0.12	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968579	2.1000 % ALLNSW 2.1 04/04/31	0	660	660	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	1'685	1'685	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	1'710	1'710	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968611	1.4000 % PFZENT 1.4 11/06/34 590	0	7'310	0	7'310 CHF	103.31%	7'551'961.00	0.16	a)
CH1319968629	1.4000 % PFZENT 1.4 03/15/38 591	0	3'600	0	3'600 CHF	104.35%	3'756'600.00	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.
CH1319968645	1.5000 % KBSH 1 1/2 04/25/36	0	2'400	0	2'400 CHF	104.20%	2'500'800.00	0.05	a)
CH1319968678	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 MAY	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968686	1.4500 % PFZENT 1.45 12/07/33 592	0	3'300	0	3'300 CHF	103.63%	3'419'790.00	0.07	a)
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	0	3'725	0	3'725 CHF	105.57%	3'932'482.50	0.09	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	1'800	875	0	2'675 CHF	102.05%	2'729'837.50	0.06	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	850	300	0	1'150 CHF	101.05%	1'162'075.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	1'200	705	0	1'905 CHF	104.70%	1'994'535.00	0.04	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	1'100	600	0	1'700 CHF	102.95%	1'750'150.00	0.04	a)
CH1321481538	2.5000 % MUNHYP 2 1/2 02/20/30 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321508330	1.5000 % CDCEPS 1 1/2 05/24/39 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.90%	1'049'000.00	0.02	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	685	685	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	410	410	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	1'900	6'690	0	8'590 CHF	107.48%	9'232'532.00	0.20	a)
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	500	1'200	0	1'700 CHF	101.55%	1'726'350.00	0.04	a)
CH1325037021	1.7000 % DAESW 1.7 10/30/29	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325037039	1.5000 % BQTESS 1 1/2 05/03/34	0	2'200	0	2'200 CHF	102.55%	2'256'100.00	0.05	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325037054	1.3000 % NEUNBG 1.3 06/12/48	0	1'750	0	1'750 CHF	110.05%	1'925'875.00	0.04	a)
CH1325037062	0.7000 % KTBS 0.7 09/06/30	0	1'350	0	1'350 CHF	100.07%	1'350'918.00	0.03	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325807845	2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	1'750	915	0	2'665 CHF	102.00%	2'718'300.00	0.06	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	0	1'955	1'955	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	305	1'025	0	1'330 CHF	124.55%	1'656'515.00	0.04	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	500	800	0	1'300 CHF	101.00%	1'313'000.00	0.03	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	0	170	170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	0	390	390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	1'240	1'240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113501	2.3750 % CLNVX 2 3/8 03/30/27	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113519	2.7500 % CLNVX 2 3/4 03/28/31	0	540	540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	640	640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113576	2.0105 % SWEDA 2.0105 10/10/30	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	2'025	0	2'025 CHF	101.00%	2'045'250.00	0.04	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	2'005	0	2'005 CHF	102.20%	2'049'110.00	0.04	a)
CH1331113634	1.6500 % GALESW 1.65 04/30/31	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331440235	1.4500 % KBSCHW 1.45 03/14/31	300	700	0	1'000 CHF	102.25%	1'022'500.00	0.02	a)
CH1335850256	1.5125 % RATFPF 1.5125 03/06/36 APR	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850264	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 APR	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	1'095	0	1'095 CHF	102.05%	1'117'447.50	0.02	a)
CH1335850280	1.1525 % NIB 1.1525 05/02/31 EMTN	0	1'015	0	1'015 CHF	102.50%	1'040'375.00	0.02	a)
CH1335850298	1.4778 % AFLBNK 1.4778 04/20/34 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	102.80%	1'439'200.00	0.03	a)
CH1335850314	0.9475 % IADB 0.9475 07/26/32	0	1'200	0	1'200 CHF	101.35%	1'216'200.00	0.03	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	540	540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337248962	1.6500 % PSPNSW 1.65 10/11/32	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337248970	1.2000 % BERN 1.2 04/22/39	0	2'315	0	2'315 CHF	104.85%	2'427'277.50	0.05	a)
CH1337248988	2.1175 % RAIFFS 2.1175 05/14/32	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337248996	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 MAY	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249002	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 MAY	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249010	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 MAY	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249028	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 MAY	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1337249044	1.1500 % KTBL 1.15 06/24/33	0	1'350	0	1'350 CHF	103.50%	1'397'250.00	0.03	a)
CH1340267090	1.3500 % KBAARG 1.35 04/30/31	0	1'350	0	1'350 CHF	101.75%	1'373'625.00	0.03	a)
CH1341034952	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 APR	0	1'850	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034960	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/20/34 752	0	2'600	0	2'600 CHF	104.43%	2'715'180.00	0.06	a)
CH1341034978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/19/39 753	0	3'955	0	3'955 CHF	106.00%	4'192'300.00	0.09	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.
CH1341034986	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/24/54 754	0	2'420	0	2'420 CHF	111.20%	2'691'040.00	0.06	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNX 1.5025 04/26/30	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035017	1.6575 % SLHNX 1.6575 04/26/33	0	675	675	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	305	305	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	3'925	0	3'925 CHF	104.35%	4'095'737.50	0.09	a)
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	0	5'215	0	5'215 CHF	102.80%	5'361'020.00	0.12	a)
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.15%	103'150.00	0.00	a)
CH1344316745	1.3750 % NESNVX 1 3/8 11/30/28	0	845	845	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316752	1.5000 % NESNVX 1 1/2 05/30/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316760	1.6250 % NESNVX 1 5/8 05/30/34	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316778	1.7500 % NESNVX 1 3/4 05/30/40	0	1'340	1'340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742856	2.1000 % KSAARA 2.1 05/15/34	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742864	1.5000 % BQNCHT 1 1/2 05/23/34	0	1'250	0	1'250 CHF	103.10%	1'288'750.00	0.03	a)
CH1346742898	1.6500 % VISECA 1.65 06/06/28	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742930	1.9000 % PGHNSW 1.9 06/07/30	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742963	2.1000 % LUZKAN 2.1 06/21/34	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742971	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 JUN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742989	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 594	0	7'050	0	7'050 CHF	103.74%	7'313'670.00	0.16	a)
CH1346742997	1.4500 % PFZENT 1.45 10/10/39 595	0	1'850	0	1'850 CHF	105.46%	1'951'010.00	0.04	a)
CH1346743037	1.2530 % RHBSZS 1.253 06/18/40	0	2'050	0	2'050 CHF	106.25%	2'178'125.00	0.05	a)
CH1346743052	1.3000 % ZURICH 1.3 06/24/37	0	4'355	0	4'355 CHF	106.05%	4'618'477.50	0.10	a)
CH1346743094	1.6000 % BQTESS 1.6 07/10/36	0	1'350	0	1'350 CHF	104.20%	1'406'700.00	0.03	a)
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	0	765	0	765 CHF	101.10%	773'415.00	0.02	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	545	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	0	180	180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614160	2.0975 % AGUAND 2.0975 05/30/29	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614178	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 06/04/35	0	1'540	0	1'540 CHF	104.00%	1'601'600.00	0.03	a)
CH1348614186	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40 JUN	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614194	1.3000 % ZURCTY 1.3 06/04/49	0	1'760	0	1'760 CHF	110.30%	1'941'280.00	0.04	a)
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	2'250	0	2'250 CHF	102.05%	2'296'125.00	0.05	a)
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348968657	1.6000 % GRKPSW 1.6 06/26/34	0	3'355	0	3'355 CHF	104.50%	3'505'975.00	0.08	a)
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	1'500	0	1'500 CHF	101.00%	1'515'000.00	0.03	a)
CH1350727785	1.6500 % SCMNVX 1.65 08/23/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1350727793	1.8000 % SCMNVX 1.8 08/23/34	0	725	725	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1350727801	2.0000 % SCMNVX 2 11/23/39	0	1'150	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	0	1'200	0	1'200 CHF	101.25%	1'215'000.00	0.03	a)
CH1353015014	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 JUL	0	3'050	3'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015022	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 07/24/37 757	0	850	0	850 CHF	103.40%	878'900.00	0.02	a)
CH1353015030	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/24/47 758	0	2'000	0	2'000 CHF	105.12%	2'102'400.00	0.05	a)
CH1353015055	1.0000 % KTBL 1 03/05/40 SEP	0	1'100	0	1'100 CHF	102.38%	1'126'158.00	0.02	a)
CH1353257749	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	105.50%	1'477'000.00	0.03	a)
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	0	440	440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257764	2.5000 % FERHOL 2 1/2 06/28/33	0	560	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	415	415	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257806	1.6000 % NOVNVX 1.6 06/18/27	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	0	975	975	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257848	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/49	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	1'450	0	1'450 CHF	101.73%	1'475'085.00	0.03	a)
CH1353257889	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 JUN	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257897	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 JUN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353257921	2.1575 % EFGBNK 2.1575 06/28/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353258168	1.1575 % IBRD 1.1575 06/11/31 EMTN	0	1'805	0	1'805 CHF	102.70%	1'853'735.00	0.04	a)
CH1356197108	2.1500 % TRAGR 2.15 06/18/27 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	0	200	200	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.
CH1356524871	1.4295 % LAUSAN 1.4295 06/28/46	0	1'400	0	1'400 CHF	109.50%	1'533'000.00	0.03	a)
CH1357852735	1.4900 % HANWHA 1.49 08/06/27	0	1'130	0	1'130 CHF	100.75%	1'138'475.00	0.02	a)
CH1357852792	0.9600 % TCV 0.96 09/04/34 EMTN	0	1'550	0	1'550 CHF	100.21%	1'553'239.50	0.03	a)
CH1360255025	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41 JUN	0	1'350	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1360612472	0.9925 % CDCEPS 0.9925 09/23/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.88%	998'840.00	0.02	a)
CH1361401701	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 JUL	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401719	1.2500 % PFZENT 1 1/4 04/19/33 596	0	2'200	0	2'200 CHF	101.84%	2'240'480.00	0.05	a)
CH1361401727	1.3000 % PFZENT 1.3 11/14/39 597	0	2'000	0	2'000 CHF	103.33%	2'066'600.00	0.05	a)
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	0	945	945	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401743	1.4000 % IWBBAS 1.4 07/13/34	0	1'120	1'120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401784	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 AUG	0	1'650	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401792	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 AUG	0	4'050	4'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401800	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 AUG	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401842	1.1250 % ZKB 1 1/8 08/16/34 158	0	3'150	0	3'150 CHF	100.20%	3'156'300.00	0.07	a)
CH1361401867	1.2000 % WKBSNW 1.2 09/03/36	0	3'400	0	3'400 CHF	99.30%	3'376'200.00	0.07	a)
CH1366517105	1.1300 % THURBK 1.13 08/29/44	0	2'000	0	2'000 CHF	100.60%	2'012'000.00	0.04	a)
CH1371736740	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 AUG	0	3'250	3'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1371736757	1.0000 % PSHYPO 1 06/07/33 759	0	1'650	0	1'650 CHF	99.81%	1'646'865.00	0.04	a)
CH1371736765	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 12/23/39 760	0	1'500	0	1'500 CHF	100.91%	1'513'650.00	0.03	a)
CH1371736773	1.0000 % PSHYPO 1 04/28/49 761	0	2'550	0	2'550 CHF	100.34%	2'558'670.00	0.06	a)
CH1373904262	0.8000 % ZURCTY 0.8 12/09/26	0	800	0	800 CHF	100.15%	801'224.00	0.02	a)
CH1373904270	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/08/34	0	2'050	0	2'050 CHF	100.28%	2'055'658.00	0.04	a)
CH1373904288	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/09/50	0	1'350	0	1'350 CHF	100.53%	1'357'141.50	0.03	a)
CH1375588105	1.1000 % KBFRIE 1.1 09/09/31	0	200	0	200 CHF	99.95%	199'902.00	0.00	a)
<b>CHF</b>							<b>3'290'528'379.90</b>	<b>71.75</b>	

#### Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

							<b>1'269'242'347.78</b>	<b>27.68</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>1'269'242'347.78</b>	<b>27.68</b>	
CH0027382941	SWC (CH) BF RESPONSIBLE CHF NT CHF	0	5'481	5'481	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	0	6'602'248	6'602'248	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0117045127	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT	0	2'048'385	2'048'385	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	7'977'407	5'260'489	325'496	12'912'399 CHF	98.30	1'269'242'347.78	27.68	a)
<b>CHF</b>							<b>1'269'242'347.78</b>	<b>27.68</b>	

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'288'648.05	0.05
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'290'528'379.90	71.75
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'269'242'347.78	27.68
Sonstige Vermögenswerte	24'061'072.52	0.52
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'120'448.25</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-68'045.69	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'052'402.56</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);	4'559'770'727.68	99.43
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

## Devisenkurse

EUR 1 = CHF 0.93915344

## 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 - 0.39	-	0.213	-	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.39	-	0.213	-	-	-

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	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
GT CHF	0.110	0.350	0.060	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® AAA-BBB 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 Betreffnisse 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.