

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 1-5 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»

Klasse	Valor	Währung
FA CHF	128604821	CHF
GT CHF	128604822	CHF
NT CHF	128604823	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	24
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	24
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	24
7	Pauschale Verwaltungskommission	25
8	Benchmark	25
9	TER	25
10	Fussnoten	26
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	27

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	12.09.2023
	bis	31.08.2024
<hr/>		
Konsolidiert	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		226'480'111.66
<hr/>		
Klasse FA CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'799'780.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'939.201
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.9296
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %
<hr/>		
Klasse GT CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'015'058.71
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		48'236.601
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.9679
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		110.7039
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %
<hr/>		
Klasse NT CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		218'665'272.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'100'339.457
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		104.1095
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		110.8546
Total Expense Ratio (TER)		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 12.09.2023)	1.88 %	1.81 %	-	-
Klasse GT CHF (Lancierung 12.09.2023)	1.90 %	1.82 %	-	-
Klasse NT CHF (Lancierung 12.09.2023)	1.97 %	1.86 %	-	-
Benchmark	1.96 %	1.84 %	-	-
Tracking Error 33)	-	0.04 %	-	-

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 12.09.2023)	-0.08 %
Klasse GT CHF (Lancierung 12.09.2023)	-0.06 %
Klasse NT CHF (Lancierung 12.09.2023)	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
Bankguthaben auf Sicht	212'791.78
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	224'635'412.60
Sonstige Vermögenswerte	1'632'898.15
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	226'481'102.53
Andere Verbindlichkeiten	-990.87
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	226'480'111.66

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	<i>Lancierung</i> 12.09.2023 31.08.2024
Ausgegebene Anteile		27'973.301
Zurückgenommene Anteile		-1'034.100
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'939.201

Klasse GT CHF	von bis	<i>Lancierung</i> 12.09.2023 31.08.2024
Ausgegebene Anteile		56'057.601
Zurückgenommene Anteile		-7'821.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		48'236.601

Klasse NT CHF	von bis	<i>Lancierung</i> 12.09.2023 31.08.2024
Ausgegebene Anteile		585'879.800
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		1'539'688.600
Zurückgenommene Anteile		-25'228.943
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'100'339.457

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	12.09.2023	14'683'785.70	146'837.857
Klasse NT CHF	12.09.2023	67'832'020.40	678'320.204
Klasse NT CHF	17.10.2023	19'299'249.35	192'229.343
Klasse NT CHF	10.11.2023	13'312'624.63	132'157.138
Klasse NT CHF	19.01.2024	23'031'463.49	226'454.937
Klasse NT CHF	08.03.2024	12'615'456.59	123'213.942
Klasse NT CHF	25.06.2024	4'171'303.14	40'475.179

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	12.09.2023 31.08.2024
Saldo aus dem Anteilverkehr		219'307'695.50
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		7'172'416.16
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		226'480'111.66

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	12.09.2023 31.08.2024
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		6'229.57
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'821'169.08
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		680'771.85
Total Ertrag		2'508'170.50
Aufwand		
Reglementarische Vergütungen		-4'267.75
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-24'595.75
Total Aufwand		-28'863.50
Nettoertrag / Verlust		2'479'307.00
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		327'133.07
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		231'192.07
Realisierter Erfolg		3'037'632.14
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		4'134'784.02
Gesamterfolg		7'172'416.16

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							224'635'412.60	99.19	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							224'635'412.60	99.19	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	0	5'720	0	5'720 CHF	112.44%	6'431'568.00	2.84	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	0	230	230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	0	370	0	370 CHF	101.45%	375'365.00	0.17	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	0	760	0	760 CHF	101.60%	772'160.00	0.34	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	0	260	0	260 CHF	101.73%	264'498.00	0.12	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	0	200	0	200 CHF	102.32%	204'640.00	0.09	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	0	1'050	0	1'050 CHF	103.55%	1'087'275.00	0.48	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	0	550	0	550 CHF	104.05%	572'275.00	0.25	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	0	360	0	360 CHF	106.40%	383'040.00	0.17	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	0	3'284	300	2'984 CHF	107.64%	3'211'977.60	1.42	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	0	220	0	220 CHF	108.05%	237'710.00	0.10	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	0	220	0	220 CHF	100.97%	222'134.00	0.10	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	0	350	0	350 CHF	105.35%	368'725.00	0.16	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	0	380	0	380 CHF	101.00%	383'800.00	0.17	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	0	260	260	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.15%	204'300.00	0.09	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	0	390	0	390 CHF	101.25%	394'875.00	0.17	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	0	350	0	350 CHF	105.15%	368'025.00	0.16	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	0	750	0	750 CHF	104.97%	787'275.00	0.35	a)
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	0	120	0	120 CHF	101.97%	122'364.00	0.05	a)
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	0	670	0	670 CHF	103.83%	695'661.00	0.31	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.65%	101'650.00	0.04	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	0	160	0	160 CHF	102.30%	163'680.00	0.07	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	0	390	0	390 CHF	102.48%	399'672.00	0.18	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	0	200	0	200 CHF	102.35%	204'700.00	0.09	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	0	340	0	340 CHF	102.28%	347'752.00	0.15	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	0	120	0	120 CHF	108.65%	130'380.00	0.06	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	0	780	0	780 CHF	104.19%	812'682.00	0.36	a)
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	0	100	0	100 CHF	104.45%	104'450.00	0.05	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	0	170	170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	0	420	0	420 CHF	101.65%	426'930.00	0.19	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	0	100	0	100 CHF	100.87%	100'870.00	0.04	a)
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	0	100	0	100 CHF	102.30%	102'300.00	0.05	a)
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	0	450	100	350 CHF	101.05%	353'675.00	0.16	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	0	300	0	300 CHF	101.20%	303'600.00	0.13	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	0	830	0	830 CHF	101.91%	845'853.00	0.37	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	0	250	0	250 CHF	101.35%	253'375.00	0.11	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	0	640	0	640 CHF	101.13%	647'232.00	0.29	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	0	260	0	260 CHF	101.30%	263'380.00	0.12	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	0	130	0	130 CHF	101.60%	132'080.00	0.06	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	0	690	0	690 CHF	102.46%	706'974.00	0.31	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	0	780	0	780 CHF	101.53%	791'934.00	0.35	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	0	3'070	3'070	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	0	300	0	300 CHF	101.85%	305'550.00	0.13	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	0	750	0	750 CHF	102.55%	769'125.00	0.34	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.40%	202'800.00	0.09	a)
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.45%	101'450.00	0.04	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	0	470	0	470 CHF	101.31%	476'157.00	0.21	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	0	200	0	200 CHF	101.35%	202'700.00	0.09	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	0	300	0	300 CHF	100.90%	302'700.00	0.13	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	0	200	0	200 CHF	100.25%	200'500.00	0.09	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	0	210	0	210 CHF	101.10%	212'310.00	0.09	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	0	330	0	330 CHF	101.45%	334'785.00	0.15	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	0	770	0	770 CHF	101.38%	780'626.00	0.34	a)
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	0	170	170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	0	270	0	270 CHF	102.15%	275'805.00	0.12	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	0	280	0	280 CHF	103.10%	288'680.00	0.13	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	0	250	0	250 CHF	102.45%	256'125.00	0.11	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	0	200	0	200 CHF	102.30%	204'600.00	0.09	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	0	225	225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	0	300	0	300 CHF	102.70%	308'100.00	0.14	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	0	335	0	335 CHF	102.10%	342'035.00	0.15	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	0	320	0	320 CHF	103.80%	332'160.00	0.15	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	0	230	0	230 CHF	101.60%	233'680.00	0.10	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	0	210	0	210 CHF	101.19%	212'499.00	0.09	a)
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	0	310	0	310 CHF	101.80%	315'580.00	0.14	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	0	4'166	700	3'466 CHF	101.20%	3'507'592.00	1.55	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	0	4'650	0	4'650 CHF	97.67%	4'541'655.00	2.01	a)
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	0	110	0	110 CHF	100.80%	110'880.00	0.05	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228531437	2.3750 % KWLLI 2 3/8 12/10/26	0	200	0	200 CHF	102.40%	204'800.00	0.09	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	0	750	0	750 CHF	101.25%	759'375.00	0.34	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	0	100	0	100 CHF	104.30%	104'300.00	0.05	a)
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	100.67%	100'670.00	0.04	a)
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	0	375	375	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	0	640	0	640 CHF	100.75%	644'800.00	0.28	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	0	450	0	450 CHF	102.40%	460'800.00	0.20	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	0	310	0	310 CHF	101.35%	314'185.00	0.14	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 07/14/26	0	200	0	200 CHF	100.95%	201'900.00	0.09	a)
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	0	310	0	310 CHF	100.65%	312'015.00	0.14	a)
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	0	200	0	200 CHF	99.90%	199'800.00	0.09	a)
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	0	230	0	230 CHF	100.55%	231'265.00	0.10	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	0	220	0	220 CHF	100.80%	221'760.00	0.10	a)
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	0	400	0	400 CHF	100.17%	400'680.00	0.18	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.75%	197'500.00	0.09	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	0	310	310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	0	170	170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	0	350	0	350 CHF	99.50%	348'250.00	0.15	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	0	1'150	0	1'150 CHF	100.27%	1'153'105.00	0.51	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	0	480	480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	0	200	0	200 CHF	99.01%	198'020.00	0.09	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	0	280	0	280 CHF	98.35%	275'380.00	0.12	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	0	100	0	100 CHF	98.30%	98'300.00	0.04	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	0	270	0	270 CHF	98.05%	264'735.00	0.12	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	0	340	0	340 CHF	99.53%	338'402.00	0.15	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	0	340	340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	0	890	0	890 CHF	98.46%	876'294.00	0.39	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	0	800	0	800 CHF	98.45%	787'600.00	0.35	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRIB 0.6 04/09/27	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	0	350	0	350 CHF	99.00%	346'500.00	0.15	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	0	220	0	220 CHF	99.96%	219'912.00	0.10	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	0	180	180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	0	100	0	100 CHF	98.13%	98'130.00	0.04	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	0	100	0	100 CHF	99.40%	99'400.00	0.04	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	0	100	0	100 CHF	99.40%	99'400.00	0.04	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	0	200	0	200 CHF	99.61%	199'220.00	0.09	a)
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	0	220	0	220 CHF	98.65%	217'030.00	0.10	a)
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	0	100	0	100 CHF	100.00%	100'000.00	0.04	a)
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	0	230	0	230 CHF	99.63%	229'149.00	0.10	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	430	430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	0	110	0	110 CHF	99.66%	109'626.00	0.05	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.40%	198'800.00	0.09	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	0	810	0	810 CHF	99.16%	803'196.00	0.35	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	0	660	660	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	0	100	0	100 CHF	99.68%	99'680.00	0.04	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	0	620	0	620 CHF	99.26%	615'412.00	0.27	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	0	500	0	500 CHF	99.60%	498'000.00	0.22	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	100.82%	100'820.00	0.04	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	0	470	170	300 CHF	99.43%	298'290.00	0.13	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	0	520	0	520 CHF	99.41%	516'932.00	0.23	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	0	550	0	550 CHF	100.75%	554'125.00	0.24	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	0	210	0	210 CHF	99.42%	208'782.00	0.09	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	0	230	0	230 CHF	99.07%	227'861.00	0.10	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	0	700	0	700 CHF	97.93%	685'510.00	0.30	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	0	140	0	140 CHF	98.98%	138'572.00	0.06	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	0	320	0	320 CHF	98.30%	314'560.00	0.14	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.70%	197'400.00	0.09	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	0	250	0	250 CHF	98.84%	247'100.00	0.11	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	0	260	0	260 CHF	100.25%	260'650.00	0.12	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	0	270	0	270 CHF	98.15%	265'005.00	0.12	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	0	400	0	400 CHF	98.81%	395'240.00	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	0	895	0	895 CHF	97.68%	874'236.00	0.39	a)
CH0310175564	0.2500 % PSYPO 0 1/4 08/05/26 625	0	870	0	870 CHF	98.75%	859'125.00	0.38	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.75%	197'500.00	0.09	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	0	200	0	200 CHF	100.19%	200'380.00	0.09	a)
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	0	230	230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	0	270	270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	0	200	0	200 CHF	98.84%	197'680.00	0.09	a)
CH0317921663	0.3750 % SCMNXX 0 3/8 03/31/28	0	410	0	410 CHF	97.90%	401'390.00	0.18	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	0	825	0	825 CHF	98.14%	809'655.00	0.36	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	0	400	0	400 CHF	98.50%	394'000.00	0.17	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	0	200	0	200 CHF	98.50%	197'000.00	0.09	a)
CH0319403777	0.3750 % PPSNSW 0 3/8 04/29/26	0	200	0	200 CHF	98.50%	197'000.00	0.09	a)
CH0319415920	0.1250 % PSYPO 0 1/8 09/06/28 627	0	870	0	870 CHF	96.85%	842'595.00	0.37	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	0	240	0	240 CHF	99.40%	238'560.00	0.11	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	0	710	310	400 CHF	98.90%	395'600.00	0.17	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.75%	197'500.00	0.09	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	0	100	0	100 CHF	98.15%	98'150.00	0.04	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	0	200	0	200 CHF	99.47%	198'940.00	0.09	a)
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	98.55%	295'650.00	0.13	a)
CH0323735628	0.1250 % PSYPO 0 1/8 12/15/27 631	0	615	0	615 CHF	97.41%	599'071.50	0.26	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	0	120	0	120 CHF	98.75%	118'500.00	0.05	a)
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	0	250	0	250 CHF	95.85%	239'625.00	0.11	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	0	100	0	100 CHF	99.25%	99'250.00	0.04	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	0	100	0	100 CHF	96.60%	96'600.00	0.04	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	0	290	0	290 CHF	97.05%	281'445.00	0.12	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	0	100	0	100 CHF	99.13%	99'130.00	0.04	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	0	290	0	290 CHF	98.45%	285'505.00	0.13	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	0	100	0	100 CHF	98.05%	98'050.00	0.04	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	0	835	0	835 CHF	97.83%	816'880.50	0.36	a)
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	0	365	0	365 CHF	98.15%	358'247.50	0.16	a)
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	0	360	0	360 CHF	98.20%	353'520.00	0.16	a)
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	0	170	170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	0	200	0	200 CHF	96.00%	192'000.00	0.08	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.70%	197'400.00	0.09	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	0	200	0	200 CHF	97.90%	195'800.00	0.09	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	120	0	120 CHF	97.05%	116'460.00	0.05	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	0	330	0	330 CHF	97.80%	322'740.00	0.14	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	0	545	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	345	345	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	0	940	0	940 CHF	97.80%	919'320.00	0.41	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	0	100	0	100 CHF	97.55%	97'550.00	0.04	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	0	200	0	200 CHF	97.85%	195'700.00	0.09	a)
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	0	240	0	240 CHF	99.13%	237'912.00	0.11	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	0	240	0	240 CHF	98.91%	237'384.00	0.10	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	0	300	0	300 CHF	97.00%	291'000.00	0.13	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.91%	197'820.00	0.09	a)
CH0347556901	0.1250 % PSYPO 0 1/8 05/06/25 643	0	520	520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSYPO 0 3/8 03/21/28 644	0	630	0	630 CHF	98.07%	617'841.00	0.27	a)
CH0350030422	0.7000 % KWOPER 0.7 01/30/26	0	100	0	100 CHF	99.22%	99'220.00	0.04	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	0	750	0	750 CHF	98.36%	737'700.00	0.33	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	330	0	330 CHF	99.01%	326'733.00	0.14	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	0	490	490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	0	300	0	300 CHF	98.50%	295'500.00	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	0	200	0	200 CHF	99.10%	198'200.00	0.09	a)
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	0	100	0	100 CHF	98.70%	98'700.00	0.04	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	0	130	0	130 CHF	99.21%	128'973.00	0.06	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	0	110	0	110 CHF	98.95%	108'845.00	0.05	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	0	420	100	320 CHF	98.80%	316'160.00	0.14	a)
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	0	820	0	820 CHF	98.77%	809'914.00	0.36	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	600	0	600 CHF	97.65%	585'900.00	0.26	a)
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	97.50%	97'500.00	0.04	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	0	1'040	0	1'040 CHF	98.42%	1'023'568.00	0.45	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	0	350	0	350 CHF	98.45%	344'575.00	0.15	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	0	360	360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	0	800	0	800 CHF	98.27%	786'160.00	0.35	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	0	645	0	645 CHF	98.87%	637'711.50	0.28	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	0	740	150	590 CHF	99.20%	585'280.00	0.26	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	0	120	0	120 CHF	98.05%	117'660.00	0.05	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	0	120	0	120 CHF	97.50%	117'000.00	0.05	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNXX 0 3/8 05/31/27	0	490	0	490 CHF	98.30%	481'670.00	0.21	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	0	300	0	300 CHF	99.60%	298'800.00	0.13	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	0	200	0	200 CHF	99.60%	199'200.00	0.09	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	0	100	0	100 CHF	99.41%	99'410.00	0.04	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	0	400	0	400 CHF	96.80%	387'200.00	0.17	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	0	200	0	200 CHF	97.75%	195'500.00	0.09	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	0	100	0	100 CHF	98.50%	98'500.00	0.04	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.20%	198'400.00	0.09	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	0	210	0	210 CHF	99.28%	208'488.00	0.09	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	0	530	0	530 CHF	98.62%	522'686.00	0.23	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	0	210	0	210 CHF	99.12%	208'152.00	0.09	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	0	895	0	895 CHF	97.82%	875'489.00	0.39	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	0	930	0	930 CHF	97.80%	909'540.00	0.40	a)
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	0	100	0	100 CHF	99.73%	99'730.00	0.04	a)
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	0	270	130	140 CHF	99.00%	138'600.00	0.06	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	0	1'045	0	1'045 CHF	97.75%	1'021'487.50	0.45	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	0	1'010	0	1'010 CHF	98.40%	993'840.00	0.44	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	0	200	0	200 CHF	99.15%	198'300.00	0.09	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	0	900	0	900 CHF	98.20%	883'800.00	0.39	a)
CH0373476784	0.5000 % KBSE 0 1/2 05/31/28	0	180	0	180 CHF	98.00%	176'400.00	0.08	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	0	210	0	210 CHF	97.85%	205'485.00	0.09	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	0	210	0	210 CHF	99.29%	208'509.00	0.09	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	0	820	0	820 CHF	97.94%	803'108.00	0.35	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	0	250	0	250 CHF	97.80%	244'500.00	0.11	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	0	210	0	210 CHF	97.65%	205'065.00	0.09	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	0	100	0	100 CHF	98.35%	98'350.00	0.04	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	0	100	0	100 CHF	99.01%	99'010.00	0.04	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	150	0	150 CHF	98.45%	147'675.00	0.07	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.27%	99'270.00	0.04	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	590	0	590 CHF	97.85%	577'315.00	0.25	a)
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	0	660	0	660 CHF	98.75%	651'750.00	0.29	a)
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125123	0.4000 % HILTI 0.4 11/08/27	0	100	0	100 CHF	97.95%	97'950.00	0.04	a)
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	0	390	0	390 CHF	99.49%	388'011.00	0.17	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	0	500	0	500 CHF	98.40%	492'000.00	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0385997041	0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.00%	196'000.00	0.09 a)	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	0	430	0	430 CHF	98.20%	422'260.00	0.19 a)	
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.09%	99'090.00	0.04 a)	
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	0	100	0	100 CHF	98.84%	98'840.00	0.04 a)	
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	0	110	0	110 CHF	98.00%	107'800.00	0.05 a)	
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	0	400	0	400 CHF	98.50%	394'000.00	0.17 a)	
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	0	750	0	750 CHF	98.91%	741'825.00	0.33 a)	
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	0	230	0	230 CHF	97.55%	224'365.00	0.10 a)	
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	0	210	0	210 CHF	99.17%	208'257.00	0.09 a)	
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	0	290	0	290 CHF	98.10%	284'490.00	0.13 a)	
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	0	120	0	120 CHF	99.80%	119'760.00	0.05 a)	
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	0	265	265	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	0	150	0	150 CHF	96.95%	145'425.00	0.06 a)	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	0	200	0	200 CHF	98.45%	196'900.00	0.09 a)	
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	0	120	0	120 CHF	96.75%	116'100.00	0.05 a)	
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	0	220	0	220 CHF	98.76%	217'272.00	0.10 a)	
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	0	220	0	220 CHF	99.44%	218'768.00	0.10 a)	
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	0	240	0	240 CHF	100.20%	240'480.00	0.11 a)	
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	0	200	0	200 CHF	99.80%	199'600.00	0.09 a)	
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	0	190	190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	0	1'000	0	1'000 CHF	98.64%	986'400.00	0.44 a)	
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	0	100	0	100 CHF	98.70%	98'700.00	0.04 a)	
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	0	250	0	250 CHF	97.95%	244'875.00	0.11 a)	
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	0	200	0	200 CHF	98.60%	197'200.00	0.09 a)	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	0	120	0	120 CHF	97.70%	117'240.00	0.05 a)	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.85%	195'700.00	0.09 a)	
CH0398913498	0.2000 % KFRIB 0.2 02/20/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	98.90%	98'900.00	0.04 a)	
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.04%	99'040.00	0.04 a)	
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	0	100	0	100 CHF	99.25%	99'250.00	0.04 a)	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	0	230	0	230 CHF	99.00%	227'700.00	0.10 a)	
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	0	100	0	100 CHF	98.15%	98'150.00	0.04 a)	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.65%	99'650.00	0.04 a)	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	0	110	0	110 CHF	99.37%	109'307.00	0.05 a)	
CH0413618353	0.7000 % KSBAAAR 0.7 05/23/28	0	200	0	200 CHF	97.00%	194'000.00	0.09 a)	
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.35%	198'700.00	0.09 a)	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	250	0	250 CHF	99.75%	249'375.00	0.11 a)	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	0	420	0	420 CHF	98.10%	412'020.00	0.18 a)	
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	0	125	0	125 CHF	99.91%	124'887.50	0.06 a)	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	0	220	0	220 CHF	97.70%	214'940.00	0.09 a)	
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	0	240	0	240 CHF	99.20%	238'080.00	0.11 a)	
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	0	960	0	960 CHF	97.11%	932'256.00	0.41 a)	
CH0419040982	0.5000 % SCMNVSX 0 1/2 03/15/29	0	220	0	220 CHF	97.75%	215'050.00	0.09 a)	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	0	230	230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	0	200	0	200 CHF	98.25%	196'500.00	0.09 a)	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	0	100	0	100 CHF	98.85%	98'850.00	0.04 a)	
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	0	100	0	100 CHF	97.60%	97'600.00	0.04 a)	
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	0	200	0	200 CHF	98.25%	196'500.00	0.09 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	0	200	0	200 CHF	97.50%	195'000.00	0.09	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	0	200	0	200 CHF	95.70%	191'400.00	0.08	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	0	550	0	550 CHF	98.15%	539'825.00	0.24	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	0	200	0	200 CHF	97.10%	194'200.00	0.09	a)
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	0	110	0	110 CHF	95.25%	104'775.00	0.05	a)
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.90%	193'800.00	0.09	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	0	220	0	220 CHF	97.60%	214'720.00	0.09	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	0	100	0	100 CHF	99.30%	99'300.00	0.04	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	670	0	670 CHF	99.05%	663'635.00	0.29	a)
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	0	525	0	525 CHF	99.21%	520'852.50	0.23	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	0	730	0	730 CHF	98.12%	716'276.00	0.32	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	0	100	0	100 CHF	98.65%	98'650.00	0.04	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	0	450	0	450 CHF	98.45%	443'025.00	0.20	a)
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.93%	99'930.00	0.04	a)
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	0	100	0	100 CHF	100.30%	100'300.00	0.04	a)
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	0	160	0	160 CHF	98.80%	158'080.00	0.07	a)
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	0	900	0	900 CHF	97.90%	881'100.00	0.39	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.45%	99'450.00	0.04	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	0	310	310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	0	100	0	100 CHF	99.14%	99'140.00	0.04	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	0	390	0	390 CHF	98.76%	385'164.00	0.17	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	0	440	0	440 CHF	99.63%	438'372.00	0.19	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNFX 0 3/4 10/12/28	0	130	0	130 CHF	98.80%	128'440.00	0.06	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.70%	99'700.00	0.04	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	0	710	0	710 CHF	98.54%	699'634.00	0.31	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	0	630	0	630 CHF	99.05%	624'015.00	0.28	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.73%	99'730.00	0.04	a)
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	0	350	0	350 CHF	98.80%	345'800.00	0.15	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	0	100	0	100 CHF	98.45%	98'450.00	0.04	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	0	550	0	550 CHF	98.53%	541'915.00	0.24	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	0	170	0	170 CHF	97.60%	165'920.00	0.07	a)
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	0	100	0	100 CHF	99.25%	99'250.00	0.04	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	0	350	0	350 CHF	97.50%	341'250.00	0.15	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	0	450	0	450 CHF	98.25%	442'125.00	0.20	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	0	250	0	250 CHF	97.15%	242'875.00	0.11	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	0	280	0	280 CHF	96.85%	271'180.00	0.12	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	0	100	0	100 CHF	96.80%	96'800.00	0.04	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	0	300	0	300 CHF	98.10%	294'300.00	0.13	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	0	210	0	210 CHF	99.19%	208'299.00	0.09	a)
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	0	100	0	100 CHF	96.85%	96'850.00	0.04	a)
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	0	200	0	200 CHF	96.95%	193'900.00	0.09	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	0	200	0	200 CHF	95.30%	190'600.00	0.08	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	0	290	0	290 CHF	96.00%	278'400.00	0.12	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	0	140	0	140 CHF	96.00%	134'400.00	0.06	a)
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	0	250	0	250 CHF	98.85%	247'125.00	0.11	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	0	110	0	110 CHF	97.30%	107'030.00	0.05	a)
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	0	240	0	240 CHF	99.50%	238'800.00	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.45%	196'900.00	0.09	a)
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	0	110	0	110 CHF	99.24%	109'164.00	0.05	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	0	180	0	180 CHF	99.08%	178'344.00	0.08	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	0	110	0	110 CHF	99.45%	109'395.00	0.05	a)
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	0	200	0	200 CHF	96.45%	192'900.00	0.09	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	0	200	0	200 CHF	99.65%	199'300.00	0.09	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	450	0	450 CHF	97.40%	438'300.00	0.19	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	0	700	0	700 CHF	96.33%	674'310.00	0.30	a)
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	0	420	420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	98.85%	98'850.00	0.04	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	0	100	0	100 CHF	99.12%	99'120.00	0.04	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	0	120	0	120 CHF	99.30%	119'160.00	0.05	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	98.40%	98'400.00	0.04	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	0	350	0	350 CHF	95.95%	335'825.00	0.15	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.85%	193'700.00	0.09	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	0	100	0	100 CHF	99.26%	99'260.00	0.04	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	0	220	0	220 CHF	97.30%	214'060.00	0.09	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	0	170	0	170 CHF	97.75%	166'175.00	0.07	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	0	100	0	100 CHF	95.70%	95'700.00	0.04	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.45%	198'900.00	0.09	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	0	380	0	380 CHF	98.94%	375'972.00	0.17	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	94.60%	236'500.00	0.10	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.50%	193'000.00	0.09	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	0	510	0	510 CHF	97.46%	497'046.00	0.22	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	0	270	0	270 CHF	97.60%	263'520.00	0.12	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	95.95%	95'950.00	0.04	a)
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.12%	198'240.00	0.09	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	0	220	0	220 CHF	97.50%	214'500.00	0.09	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	0	130	0	130 CHF	98.32%	127'816.00	0.06	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	100	0	100 CHF	93.55%	93'550.00	0.04	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	0	380	0	380 CHF	97.70%	371'260.00	0.16	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.65%	195'300.00	0.09	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	0	500	0	500 CHF	98.60%	493'000.00	0.22	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	97.75%	97'750.00	0.04	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	0	100	0	100 CHF	98.75%	98'750.00	0.04	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	0	310	0	310 CHF	97.05%	300'855.00	0.13	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	0	180	0	180 CHF	97.00%	174'600.00	0.08	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	0	260	0	260 CHF	97.00%	252'200.00	0.11	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	95.60%	191'200.00	0.08	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	0	220	0	220 CHF	96.05%	211'310.00	0.09	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.15%	196'300.00	0.09	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	96.55%	96'550.00	0.04	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.16%	99'160.00	0.04	a)
CH0508785737	0.1500 % SANSCF 0.15 12/10/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785745	1.5000 % TEMNSW 1 1/2 11/28/25	0	165	0	165 CHF	98.60%	162'690.00	0.07	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	0	360	0	360 CHF	97.63%	351'468.00	0.16	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	0	200	0	200 CHF	95.15%	190'300.00	0.08	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	0	280	0	280 CHF	94.35%	264'180.00	0.12	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	96.00%	96'000.00	0.04	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	95.60%	191'200.00	0.08	a)
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	95.80%	239'500.00	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	0	240	0	240 CHF	99.05%	237'720.00	0.10 a)	
CH0520663664	0.5000 % BANORT 0 1/2 12/06/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	0	400	0	400 CHF	95.50%	382'000.00	0.17 a)	
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	98.05%	98'050.00	0.04 a)	
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	0	320	0	320 CHF	98.10%	313'920.00	0.14 a)	
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	0	200	0	200 CHF	97.65%	195'300.00	0.09 a)	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	0	595	0	595 CHF	96.83%	576'138.50	0.25 a)	
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	0	100	0	100 CHF	98.30%	98'300.00	0.04 a)	
CH0528881193	0.2975 % BNS 0.2975 04/03/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	97.50%	97'500.00	0.04 a)	
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	0	310	0	310 CHF	98.05%	303'955.00	0.13 a)	
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	97.55%	292'650.00	0.13 a)	
CH0535271206	0.1550 % RY 0.155 04/06/27	0	100	0	100 CHF	97.75%	97'750.00	0.04 a)	
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	0	390	0	390 CHF	99.60%	388'440.00	0.17 a)	
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	0	420	0	420 CHF	97.15%	408'030.00	0.18 a)	
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	0	100	0	100 CHF	99.20%	99'200.00	0.04 a)	
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	0	540	0	540 CHF	96.55%	521'370.00	0.23 a)	
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	220	0	220 CHF	97.15%	213'730.00	0.09 a)	
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	0	480	0	480 CHF	97.68%	468'864.00	0.21 a)	
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	0	230	0	230 CHF	98.05%	225'515.00	0.10 a)	
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	0	760	0	760 CHF	97.03%	737'428.00	0.33 a)	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.80%	199'600.00	0.09 a)	
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	0	240	0	240 CHF	99.56%	238'944.00	0.11 a)	
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	0	220	120	100 CHF	100.00%	100'000.00	0.04 a)	
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	0	220	0	220 CHF	98.30%	216'260.00	0.10 a)	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	0	220	0	220 CHF	96.55%	212'410.00	0.09 a)	
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	0	100	0	100 CHF	99.21%	99'210.00	0.04 a)	
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	0	200	0	200 CHF	99.35%	198'700.00	0.09 a)	
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	300	0	300 CHF	98.35%	295'050.00	0.13 a)	
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.28%	99'280.00	0.04 a)	
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	99.32%	99'320.00	0.04 a)	
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	0	400	0	400 CHF	96.80%	387'200.00	0.17 a)	
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.05%	196'100.00	0.09 a)	
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	0	200	0	200 CHF	99.27%	198'540.00	0.09 a)	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	0	210	0	210 CHF	99.70%	209'370.00	0.09 a)	
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	0	100	0	100 CHF	98.00%	98'000.00	0.04 a)	
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	0	120	0	120 CHF	97.30%	116'760.00	0.05 a)	
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779037	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 5JL	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	0	320	0	320 CHF	95.75%	306'400.00	0.14 a)	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	0	320	0	320 CHF	99.14%	317'248.00	0.14 a)	
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	0	220	0	220 CHF	96.20%	211'640.00	0.09 a)	
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	0	100	0	100 CHF	98.30%	98'300.00	0.04 a)	
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	0	320	0	320 CHF	96.00%	307'200.00	0.14 a)	
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	0	260	0	260 CHF	95.80%	249'080.00	0.11 a)	
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	0	140	0	140 CHF	99.13%	138'782.00	0.06 a)	
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	0	100	0	100 CHF	96.25%	96'250.00	0.04 a)	
CH0572899091	0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	0	200	0	200 CHF	96.35%	192'700.00	0.09 a)	
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	0	200	0	200 CHF	98.00%	196'000.00	0.09 a)	
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	0	700	0	700 CHF	95.95%	671'650.00	0.30 a)	
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	0	100	0	100 CHF	97.55%	97'550.00	0.04 a)	
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.10%	192'200.00	0.08 a)	
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	97.40%	97'400.00	0.04 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	95.75%	191'500.00	0.08	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	0	180	180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.20%	194'400.00	0.09	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	400	0	400 CHF	94.85%	379'400.00	0.17	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	0	120	0	120 CHF	98.75%	118'500.00	0.05	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	0	1'000	0	1'000 CHF	96.84%	968'400.00	0.43	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	0	320	0	320 CHF	95.75%	306'400.00	0.14	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	0	200	0	200 CHF	97.25%	194'500.00	0.09	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	600	0	600 CHF	96.35%	578'100.00	0.26	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	0	100	0	100 CHF	98.30%	98'300.00	0.04	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	0	200	0	200 CHF	96.00%	192'000.00	0.08	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	0	520	0	520 CHF	96.95%	504'140.00	0.22	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	96.75%	580'500.00	0.26	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	0	150	0	150 CHF	96.30%	144'450.00	0.06	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.90%	195'800.00	0.09	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.75%	193'500.00	0.09	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	0	400	0	400 CHF	97.15%	388'600.00	0.17	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	0	200	0	200 CHF	96.00%	192'000.00	0.08	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	150	0	150 CHF	95.00%	142'500.00	0.06	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.00%	192'000.00	0.08	a)
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	260	0	260 CHF	96.50%	250'900.00	0.11	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	96.40%	289'200.00	0.13	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	0	300	0	300 CHF	97.30%	291'900.00	0.13	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	250	0	250 CHF	94.45%	236'125.00	0.10	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	0	220	0	220 CHF	97.08%	213'576.00	0.09	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.05%	194'100.00	0.09	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	0	100	0	100 CHF	96.65%	96'650.00	0.04	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	0	320	0	320 CHF	95.05%	304'160.00	0.13	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	0	100	0	100 CHF	98.92%	98'920.00	0.04	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	0	100	0	100 CHF	98.40%	98'400.00	0.04	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	0	200	0	200 CHF	98.10%	196'200.00	0.09	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	95.15%	190'300.00	0.08	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.00%	194'000.00	0.09	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	95.95%	191'900.00	0.08	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	0	540	0	540 CHF	98.67%	532'818.00	0.24	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.45%	192'900.00	0.09	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	95.75%	287'250.00	0.13	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.15%	194'300.00	0.09	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	0	270	0	270 CHF	95.30%	257'310.00	0.11	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	150	0	150 CHF	95.60%	143'400.00	0.06	a)
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	0	420	0	420 CHF	98.20%	412'440.00	0.18	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	97.15%	97'150.00	0.04	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	0	310	0	310 CHF	97.80%	303'180.00	0.13	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	0	200	0	200 CHF	96.30%	192'600.00	0.09	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	450	0	450 CHF	97.50%	438'750.00	0.19	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.70%	193'400.00	0.09	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	0	220	0	220 CHF	97.65%	214'830.00	0.09	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	0	220	0	220 CHF	96.20%	211'640.00	0.09	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	0	320	0	320 CHF	96.10%	307'520.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	0	350	0	350 CHF	97.80%	342'300.00	0.15	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.30%	194'600.00	0.09	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	0	400	0	400 CHF	96.75%	387'000.00	0.17	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	0	250	0	250 CHF	96.20%	240'500.00	0.11	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	0	310	0	310 CHF	96.66%	299'646.00	0.13	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	0	220	0	220 CHF	95.95%	211'090.00	0.09	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	96.45%	241'125.00	0.11	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	94.50%	189'000.00	0.08	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	0	110	0	110 CHF	97.40%	107'140.00	0.05	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	0	100	0	100 CHF	96.45%	96'450.00	0.04	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	0	490	0	490 CHF	98.34%	481'866.00	0.21	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	0	250	0	250 CHF	96.46%	241'150.00	0.11	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	0	340	0	340 CHF	97.85%	332'690.00	0.15	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	0	600	0	600 CHF	97.75%	586'500.00	0.26	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.45%	192'900.00	0.09	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	0	120	0	120 CHF	97.90%	117'480.00	0.05	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	96.15%	192'300.00	0.08	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	97.50%	195'000.00	0.09	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	0	280	0	280 CHF	98.35%	275'380.00	0.12	a)
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	0	100	0	100 CHF	96.25%	96'250.00	0.04	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	0	230	0	230 CHF	98.44%	226'412.00	0.10	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.70%	197'400.00	0.09	a)
CH1164800661	0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29	0	120	0	120 CHF	96.85%	116'220.00	0.05	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	0	1'370	470	900 CHF	98.95%	890'550.00	0.39	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	0	120	0	120 CHF	98.32%	117'984.00	0.05	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	0	200	0	200 CHF	98.40%	196'800.00	0.09	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	0	300	0	300 CHF	98.20%	294'600.00	0.13	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	0	330	0	330 CHF	99.20%	327'360.00	0.14	a)
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	0	100	0	100 CHF	99.20%	99'200.00	0.04	a)
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	0	200	0	200 CHF	97.15%	194'300.00	0.09	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	0	350	0	350 CHF	100.50%	351'750.00	0.16	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	0	360	0	360 CHF	100.60%	362'160.00	0.16	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	0	110	0	110 CHF	100.10%	110'110.00	0.05	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	0	120	0	120 CHF	98.35%	118'020.00	0.05	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	0	320	0	320 CHF	98.75%	316'000.00	0.14	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.75%	197'500.00	0.09	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	0	220	0	220 CHF	98.55%	216'810.00	0.10	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	98.95%	98'950.00	0.04	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	0	200	0	200 CHF	100.60%	201'200.00	0.09	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	0	200	0	200 CHF	100.10%	200'200.00	0.09	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	0	100	0	100 CHF	99.40%	99'400.00	0.04	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	0	100	0	100 CHF	98.70%	98'700.00	0.04	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	0	220	0	220 CHF	99.65%	219'230.00	0.10	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	0	100	0	100 CHF	99.50%	99'500.00	0.04	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	99.40%	248'500.00	0.11	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	0	210	0	210 CHF	99.60%	209'160.00	0.09	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	0	250	0	250 CHF	99.80%	249'500.00	0.11	a)
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.80%	199'600.00	0.09	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.80%	201'600.00	0.09	a)
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	0	350	0	350 CHF	100.95%	353'325.00	0.16	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	0	220	0	220 CHF	101.75%	223'850.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	200	0	200 CHF	99.75%	199'500.00	0.09	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	0	300	0	300 CHF	100.40%	301'200.00	0.13	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	0	200	0	200 CHF	101.50%	203'000.00	0.09	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	220	0	220 CHF	100.00%	220'000.00	0.10	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	0	110	0	110 CHF	99.20%	109'120.00	0.05	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	0	200	0	200 CHF	100.14%	200'280.00	0.09	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.20%	200'400.00	0.09	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.85%	201'700.00	0.09	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	0	210	0	210 CHF	100.90%	211'890.00	0.09	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	100.60%	100'600.00	0.04	a)
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	0	200	0	200 CHF	99.90%	199'800.00	0.09	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	0	140	0	140 CHF	99.81%	139'734.00	0.06	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	0	550	0	550 CHF	100.50%	552'750.00	0.24	a)
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	0	200	0	200 CHF	100.25%	200'500.00	0.09	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	0	320	0	320 CHF	102.50%	328'000.00	0.14	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	0	100	0	100 CHF	100.06%	100'060.00	0.04	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.10%	200'200.00	0.09	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	0	200	0	200 CHF	101.90%	203'800.00	0.09	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.65%	201'300.00	0.09	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	0	200	0	200 CHF	100.25%	200'500.00	0.09	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	0	140	0	140 CHF	102.40%	143'360.00	0.06	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	0	100	0	100 CHF	102.90%	102'900.00	0.05	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	0	240	0	240 CHF	102.15%	245'160.00	0.11	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	0	200	0	200 CHF	101.95%	203'900.00	0.09	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.45%	202'900.00	0.09	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	0	320	0	320 CHF	100.70%	322'240.00	0.14	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	0	200	0	200 CHF	104.00%	208'000.00	0.09	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	0	300	0	300 CHF	101.30%	303'900.00	0.13	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	0	600	0	600 CHF	101.15%	606'900.00	0.27	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	0	260	0	260 CHF	100.60%	261'560.00	0.12	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.05%	204'100.00	0.09	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	0	200	0	200 CHF	101.45%	202'900.00	0.09	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	0	100	0	100 CHF	99.87%	99'870.00	0.04	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.35%	204'700.00	0.09	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	0	100	0	100 CHF	101.00%	101'000.00	0.04	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.85%	199'700.00	0.09	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	0	330	0	330 CHF	102.10%	336'930.00	0.15	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	0	110	0	110 CHF	99.87%	109'857.00	0.05	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	0	200	0	200 CHF	99.95%	199'900.00	0.09	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	0	250	0	250 CHF	101.45%	253'625.00	0.11	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	0	450	0	450 CHF	104.75%	471'375.00	0.21	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.30%	200'600.00	0.09	a)
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	0	240	0	240 CHF	100.90%	242'160.00	0.11	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	0	290	0	290 CHF	103.35%	299'715.00	0.13	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	0	300	0	300 CHF	102.53%	307'590.00	0.14	a)
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	0	100	0	100 CHF	102.10%	102'100.00	0.05	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	0	100	0	100 CHF	101.95%	101'950.00	0.05	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	0	350	0	350 CHF	105.65%	369'775.00	0.16	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	0	210	0	210 CHF	104.45%	219'345.00	0.10	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	0	100	0	100 CHF	101.27%	101'270.00	0.04	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	0	355	0	355 CHF	101.11%	358'940.50	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	0	200	0	200 CHF	102.75%	205'500.00	0.09 a)	
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	0	200	0	200 CHF	103.45%	206'900.00	0.09 a)	
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	0	120	0	120 CHF	101.50%	121'800.00	0.05 a)	
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.50%	101'500.00	0.04 a)	
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	0	730	280	450 CHF	100.95%	454'275.00	0.20 a)	
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	0	100	0	100 CHF	104.30%	104'300.00	0.05 a)	
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	0	200	0	200 CHF	101.10%	202'200.00	0.09 a)	
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	104.50%	209'000.00	0.09 a)	
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.10%	103'100.00	0.05 a)	
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	320	0	320 CHF	103.30%	330'560.00	0.15 a)	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	104.95%	209'900.00	0.09 a)	
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.70%	207'400.00	0.09 a)	
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	0	100	0	100 CHF	101.87%	101'870.00	0.04 a)	
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	0	100	0	100 CHF	101.13%	101'130.00	0.04 a)	
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	0	200	0	200 CHF	104.15%	208'300.00	0.09 a)	
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.35%	204'700.00	0.09 a)	
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.05%	103'050.00	0.05 a)	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	0	240	0	240 CHF	102.90%	246'960.00	0.11 a)	
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	0	260	0	260 CHF	100.68%	261'768.00	0.12 a)	
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	0	200	0	200 CHF	103.00%	206'000.00	0.09 a)	
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	0	210	0	210 CHF	100.94%	211'974.00	0.09 a)	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	390	0	390 CHF	104.95%	409'305.00	0.18 a)	
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	100.84%	100'840.00	0.04 a)	
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.45%	206'900.00	0.09 a)	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	170	0	170 CHF	101.50%	172'550.00	0.08 a)	
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	350	0	350 CHF	101.50%	355'250.00	0.16 a)	
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	0	200	0	200 CHF	104.90%	209'800.00	0.09 a)	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	0	110	0	110 CHF	100.60%	110'660.00	0.05 a)	
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	200	0	200 CHF	101.59%	203'180.00	0.09 a)	
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	200	0	200 CHF	105.40%	210'800.00	0.09 a)	
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	0	200	0	200 CHF	102.08%	204'160.00	0.09 a)	
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	0	260	0	260 CHF	101.40%	263'640.00	0.12 a)	
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.80%	207'600.00	0.09 a)	
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	0	320	0	320 CHF	100.85%	322'720.00	0.14 a)	
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	0	120	0	120 CHF	102.50%	123'000.00	0.05 a)	
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	0	120	0	120 CHF	103.05%	123'660.00	0.05 a)	
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	104.75%	209'500.00	0.09 a)	
CH1231312716	2.1500 % KOROil 2.15 12/19/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	0	100	0	100 CHF	99.90%	99'900.00	0.04 a)	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	0	120	0	120 CHF	101.49%	121'788.00	0.05 a)	
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	0	200	0	200 CHF	102.75%	205'500.00	0.09 a)	
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	0	100	0	100 CHF	101.25%	101'250.00	0.04 a)	
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	0	100	0	100 CHF	103.25%	103'250.00	0.05 a)	
CH1236363409	1.7575 % Nwide 1.7575 01/23/26	0	220	0	220 CHF	101.02%	222'244.00	0.10 a)	
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	0	200	0	200 CHF	103.20%	206'400.00	0.09 a)	
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	0	200	0	200 CHF	101.31%	202'620.00	0.09 a)	
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	0	200	0	200 CHF	100.35%	200'700.00	0.09 a)	
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	320	140	180 CHF	106.05%	190'890.00	0.08 a)	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	500	0	500 CHF	103.90%	519'500.00	0.23 a)	
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	150	0	150 CHF	105.35%	158'025.00	0.07 a)	
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	0	200	0	200 CHF	103.65%	207'300.00	0.09 a)	
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	0	200	0	200 CHF	103.80%	207'600.00	0.09 a)	
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	0	700	0	700 CHF	103.64%	725'480.00	0.32 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	100.66%	100'660.00	0.04	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	0	200	0	200 CHF	104.20%	208'400.00	0.09	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	0	350	0	350 CHF	102.50%	358'750.00	0.16	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	230	0	230 CHF	102.65%	236'095.00	0.10	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.10%	101'100.00	0.04	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.75%	203'500.00	0.09	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	104.10%	260'250.00	0.11	a)
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	0	100	0	100 CHF	101.12%	101'120.00	0.04	a)
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	0	110	0	110 CHF	103.95%	114'345.00	0.05	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLILJ 2.35 03/01/27	0	100	0	100 CHF	102.30%	102'300.00	0.05	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.90%	205'800.00	0.09	a)
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	0	100	0	100 CHF	105.50%	105'500.00	0.05	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	0	220	0	220 CHF	100.97%	222'134.00	0.10	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	0	120	0	120 CHF	102.55%	123'060.00	0.05	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.55%	211'100.00	0.09	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.65%	211'300.00	0.09	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.85%	205'700.00	0.09	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.95%	203'900.00	0.09	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	105.30%	263'250.00	0.12	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	200	0	200 CHF	102.65%	205'300.00	0.09	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.38%	101'380.00	0.04	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.70%	207'400.00	0.09	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	130	0	130 CHF	101.48%	131'924.00	0.06	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.90%	207'800.00	0.09	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	0	310	0	310 CHF	102.20%	316'820.00	0.14	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	400	0	400 CHF	103.90%	415'600.00	0.18	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	470	0	470 CHF	103.00%	484'100.00	0.21	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	0	240	0	240 CHF	105.15%	252'360.00	0.11	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	220	0	220 CHF	104.10%	229'020.00	0.10	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	240	0	240 CHF	101.70%	244'080.00	0.11	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	300	0	300 CHF	104.45%	313'350.00	0.14	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	320	0	320 CHF	103.85%	332'320.00	0.15	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	230	0	230 CHF	102.90%	236'670.00	0.10	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.00%	210'000.00	0.09	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	200	0	200 CHF	101.35%	202'700.00	0.09	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.35%	206'700.00	0.09	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	210	0	210 CHF	103.35%	217'035.00	0.10	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	300	0	300 CHF	103.50%	310'500.00	0.14	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	380	0	380 CHF	103.75%	394'250.00	0.17	a)
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.10%	210'200.00	0.09	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	270	0	270 CHF	101.60%	274'320.00	0.12	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	107.20%	107'200.00	0.05	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	440	0	440 CHF	102.85%	452'540.00	0.20	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.02%	101'020.00	0.04	a)
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.45%	210'900.00	0.09	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	400	0	400 CHF	104.45%	417'800.00	0.18	a)
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	0	200	0	200 CHF	103.40%	206'800.00	0.09	a)
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	0	200	0	200 CHF	100.75%	201'500.00	0.09	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	0	100	0	100 CHF	102.45%	102'450.00	0.05	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	0	120	0	120 CHF	101.80%	122'160.00	0.05	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	0	200	0	200 CHF	101.75%	203'500.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	300	0	300 CHF	102.92%	308'760.00	0.14	a)
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	0	160	0	160 CHF	101.50%	162'400.00	0.07	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	0	100	0	100 CHF	101.35%	101'350.00	0.04	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	330	0	330 CHF	102.95%	339'735.00	0.15	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	0	220	0	220 CHF	102.10%	224'620.00	0.10	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.45%	210'900.00	0.09	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	0	200	0	200 CHF	103.25%	206'500.00	0.09	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	200	0	200 CHF	103.00%	206'000.00	0.09	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	0	100	0	100 CHF	103.00%	103'000.00	0.05	a)
CH1271007952	2.3750 % HYNOE 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	105.00%	210'000.00	0.09	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.45%	204'900.00	0.09	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	104.15%	208'300.00	0.09	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.40%	103'400.00	0.05	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	510	190	320 CHF	105.15%	336'480.00	0.15	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	250	0	250 CHF	101.12%	252'800.00	0.11	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	0	230	0	230 CHF	101.13%	232'599.00	0.10	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.45%	204'900.00	0.09	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	0	320	0	320 CHF	104.00%	332'800.00	0.15	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.05%	202'100.00	0.09	a)
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	0	100	0	100 CHF	101.50%	101'500.00	0.04	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.95%	103'950.00	0.05	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	0	200	0	200 CHF	104.60%	209'200.00	0.09	a)
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	0	100	0	100 CHF	101.37%	101'370.00	0.04	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN	0	130	0	130 CHF	101.32%	131'716.00	0.06	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	105.35%	105'350.00	0.05	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	100	0	100 CHF	101.41%	101'410.00	0.04	a)
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	0	200	0	200 CHF	105.30%	210'600.00	0.09	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	0	100	0	100 CHF	101.95%	101'950.00	0.05	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.20%	103'200.00	0.05	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	104.15%	208'300.00	0.09	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	0	220	0	220 CHF	102.35%	225'170.00	0.10	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	330	0	330 CHF	103.40%	341'220.00	0.15	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.20%	204'400.00	0.09	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	490	0	490 CHF	102.55%	502'495.00	0.22	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.80%	205'600.00	0.09	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	240	0	240 CHF	102.00%	244'800.00	0.11	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	250	0	250 CHF	105.05%	262'625.00	0.12	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	0	210	0	210 CHF	103.25%	216'825.00	0.10	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	270	0	270 CHF	104.25%	281'475.00	0.12	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	200	0	200 CHF	99.40%	198'800.00	0.09	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	300	0	300 CHF	102.30%	306'900.00	0.14	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	200	0	200 CHF	102.65%	205'300.00	0.09	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	0	500	0	500 CHF	102.50%	512'500.00	0.23	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	270	0	270 CHF	104.35%	281'745.00	0.12	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	310	0	310 CHF	101.95%	316'045.00	0.14	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	0	200	0	200 CHF	104.05%	208'100.00	0.09	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	650	0	650 CHF	101.75%	661'375.00	0.29	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.85%	201'700.00	0.09	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	400	0	400 CHF	103.05%	412'200.00	0.18	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRIB 1.9 09/08/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.50%	207'000.00	0.09	a)
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	0	100	0	100 CHF	101.10%	101'100.00	0.04	a)
CH1291601966	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28 MAY	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	0	220	0	220 CHF	102.65%	225'830.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	0	300	0	300 CHF	103.05%	309'150.00	0.14	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	230	0	230 CHF	102.00%	234'600.00	0.10	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	580	0	580 CHF	101.80%	590'440.00	0.26	a)
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	0	220	0	220 CHF	103.50%	227'700.00	0.10	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.20%	103'200.00	0.05	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	240	0	240 CHF	102.45%	245'880.00	0.11	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	210	0	210 CHF	104.10%	218'610.00	0.10	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	240	0	240 CHF	103.25%	247'800.00	0.11	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	103.95%	207'900.00	0.09	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	104.35%	208'700.00	0.09	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.75%	103'750.00	0.05	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	200	0	200 CHF	101.65%	203'300.00	0.09	a)
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	100	0	100 CHF	102.55%	102'550.00	0.05	a)
CH1296291003	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 DEC	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	300	0	300 CHF	105.70%	317'100.00	0.14	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.80%	203'600.00	0.09	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	200	0	200 CHF	101.50%	203'000.00	0.09	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	100	0	100 CHF	103.00%	103'000.00	0.05	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	250	0	250 CHF	103.70%	259'250.00	0.11	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	0	100	0	100 CHF	101.50%	101'500.00	0.04	a)
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	0	150	0	150 CHF	102.05%	153'075.00	0.07	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	0	420	0	420 CHF	102.10%	428'820.00	0.19	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	200	0	200 CHF	103.20%	206'400.00	0.09	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	330	0	330 CHF	101.90%	336'270.00	0.15	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	250	0	250 CHF	101.95%	254'875.00	0.11	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	300	100	200 CHF	102.55%	205'100.00	0.09	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	130	0	130 CHF	101.15%	131'495.00	0.06	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	500	0	500 CHF	101.51%	507'550.00	0.22	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLILI 2 1/4 12/05/25	0	120	0	120 CHF	101.31%	121'572.00	0.05	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	0	100	0	100 CHF	101.60%	101'600.00	0.04	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	0	100	0	100 CHF	101.75%	101'750.00	0.04	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	0	250	0	250 CHF	103.70%	259'250.00	0.11	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	100	0	100 CHF	103.15%	103'150.00	0.05	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	300	0	300 CHF	102.05%	306'150.00	0.14	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	200	0	200 CHF	101.05%	202'100.00	0.09	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	200	0	200 CHF	102.95%	205'900.00	0.09	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	150	0	150 CHF	103.90%	155'850.00	0.07	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	102.80%	205'600.00	0.09	a)
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	490	0	490 CHF	102.60%	502'740.00	0.22	a)
CH1321508363	1.5650 % EDF 1.565 09/06/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	99.94%	249'837.50	0.11	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	0	290	290	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274063	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 FEB	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	0	120	0	120 CHF	101.55%	121'860.00	0.05	a)
CH1325037021	1.7000 % DAESW 1.7 10/30/29	0	230	0	230 CHF	101.75%	234'025.00	0.10	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	150	0	150 CHF	101.35%	152'025.00	0.07	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	350	0	350 CHF	102.00%	357'000.00	0.16	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	400	0	400 CHF	103.30%	413'200.00	0.18	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	0	200	0	200 CHF	101.00%	202'000.00	0.09	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	0	350	0	350 CHF	101.70%	355'950.00	0.16	a)
CH1331113501	2.3750 % CLNVX 2 3/8 03/30/27	0	265	0	265 CHF	102.20%	270'830.00	0.12	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	300	0	300 CHF	102.85%	308'550.00	0.14	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	250	0	250 CHF	101.00%	252'500.00	0.11	a)
CH1335850306	2.8000 % UINT 2.8 07/23/27	0	150	0	150 CHF	101.10%	151'650.00	0.07	a)
CH1336918763	2.2250 % AYYFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.95%	203'900.00	0.09	a)
CH1337248996	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 MAY	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034952	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 APR	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034994	1.4100 % SLHNVX 1.41 04/26/27	0	200	0	200 CHF	100.75%	201'500.00	0.09	a)
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	100	0	100 CHF	101.60%	101'600.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 12.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28 4Y	0	350	0	350 CHF	101.40%	354'900.00	0.16	a)
CH1344316745	1.3750 % NESNVX 1 3/8 11/30/28	0	200	0	200 CHF	101.50%	203'000.00	0.09	a)
CH1346742898	1.6500 % VISECA 1.65 06/06/28	0	150	0	150 CHF	101.30%	151'950.00	0.07	a)
CH1346743060	1.7500 % COOPSW 1 3/4 07/17/28	0	250	0	250 CHF	102.00%	255'000.00	0.11	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	200	0	200 CHF	101.80%	203'600.00	0.09	a)
CH1348614046	1.8000 % BARY 1.8 05/15/26	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	200	0	200 CHF	102.10%	204'200.00	0.09	a)
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	400	0	400 CHF	102.45%	409'800.00	0.18	a)
CH1348614160	2.0975 % AGUAND 2.0975 05/30/29	0	100	0	100 CHF	101.50%	101'500.00	0.04	a)
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	150	0	150 CHF	102.05%	153'075.00	0.07	a)
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	200	0	200 CHF	101.00%	202'000.00	0.09	a)
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	0	150	0	150 CHF	101.25%	151'875.00	0.07	a)
CH1353257756	2.2500 % FERHOL 2 1/4 06/28/29	0	250	0	250 CHF	102.05%	255'125.00	0.11	a)
CH1353257806	1.6000 % NOVNVX 1.6 06/18/27	0	600	0	600 CHF	101.95%	611'700.00	0.27	a)
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	450	0	450 CHF	101.73%	457'785.00	0.20	a)
CH1353257913	1.9950 % EFGBNK 1.995 06/28/27	0	350	0	350 CHF	101.40%	354'900.00	0.16	a)
CH1356197108	2.1500 % TRAGR 2.15 06/18/27 EMTN	0	300	0	300 CHF	101.55%	304'650.00	0.13	a)
CH1357852651	1.6925 % SRAIL 1.6925 07/12/29	0	200	0	200 CHF	101.35%	202'700.00	0.09	a)
CH1357852677	1.3800 % IBESM 1.38 07/11/28 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.95%	201'900.00	0.09	a)
CH1357852735	1.4900 % HANWHA 1.49 08/06/27	0	130	0	130 CHF	100.75%	130'975.00	0.06	a)
CH1357852784	1.4500 % IRENSW 1.45 10/16/26	0	150	0	150 CHF	100.35%	150'525.00	0.07	a)
CH1357852818	1.4450 % NWG 1.445 08/27/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	100.15%	200'300.00	0.09	a)
CH1361401701	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 JUL	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1361401735	1.3000 % IWBBAS 1.3 07/13/29	0	135	0	135 CHF	101.25%	136'687.50	0.06	a)
CH1361401891	1.5606 % BCHNSW 1.5606 09/29/28	0	200	0	200 CHF	99.93%	199'868.00	0.09	a)
CH1371736740	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 AUG	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1371736807	0.9850 % ROSW 0.985 09/06/29	0	250	0	250 CHF	99.92%	249'787.50	0.11	a)
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	250	0	250 CHF	99.83%	249'562.50	0.11	a)
CH1373904353	1.2000 % PSPNSW 1.2 09/20/29	0	150	0	150 CHF	99.78%	149'673.00	0.07	a)
CH1373904403	1.6000 % GALDSW 1.6 09/27/28	0	250	0	250 CHF	100.38%	250'960.00	0.11	a)
CH1377443812	2.1275 % ECLCI 2.1275 09/26/29	0	150	0	150 CHF	99.96%	149'938.50	0.07	a)
CHF							224'635'412.60	99.19	

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

							0.00	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							0.00	0.00
CH0215803898	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB 1-5 CHF NT	0	1'602'908	1'602'908	0 CHF	0.00	0.00	0.00
CHF							0.00	0.00

Vermögensaufstellung

		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		212'791.78	0.09
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		224'635'412.60	99.19
Sonstige Vermögenswerte		1'632'898.15	0.72
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		226'481'102.53	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-990.87	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		226'480'111.66	

Bewertungskategorien

		Kurswert CHF	in % 7)
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen regelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	224'635'412.60	99.19
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 12.09.2023 - 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 - 0.34	-	0.309	-	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.34	-	0.309	-	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.34	-	0.309	-	-	-

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: 12.09.2023 - 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	0.130	0.050	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000

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

8 Benchmark

SBI® AAA-BBB 1 -5 TR

9 TER

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

10 Fussnoten

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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