



# BEKB OBLIGATIONEN CHF

Jahresbericht per 31.08.2023

Teilvermögen des BEKB Obligationenfonds  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

| <b>Klasse</b> | <b>Valor</b> | <b>Währung</b> |
|---------------|--------------|----------------|
| A             | 30460996     | CHF            |
| B             | 30528083     | CHF            |
| It            | 24652013     | CHF            |
| Nt            | 24652057     | CHF            |

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 20.12.2023

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2023

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

BEKB Obligationenfonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ BEKB Obligationen CHF
- ▶ BEKB Obligationen Global Staatsanleihen
- ▶ BEKB Obligationen Global Unternehmensanleihen
- ▶ BEKB Obligationen Nachhaltig CHF
- ▶ BEKB Obligationen Nachhaltig Global
- ▶ BEKB Obligationen CHF Short Duration

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes KAG

## Inhaltsverzeichnis

|    |   |    |
|----|---|----|
| 1  | Organisation und Verwaltung   | 2  |
| 2  | Vertriebsorganisation   | 3  |
| 3  | Abschlusszahlen   | 4  |
| 4  | Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I               | 16 |
| 5  | Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung | 16 |
| 6  | Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte                     | 16 |
| 7  | Verwaltungskommission   | 17 |
| 8  | Benchmark   | 17 |
| 9  | TER   | 17 |
| 10 | Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023                               | 18 |
| 11 | Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023                              | 18 |
| 12 | Fussnoten   | 18 |
| 13 | Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte    | 19 |
| 14 | Pflichtpublikationen  | 21 |

# 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 (ab 03.01.2023)  
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 Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern  
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

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

|   | von        | 01.09.2022       | 01.09.2021     | 01.09.2020     | 01.09.2019     |
|---|------------|------------------|----------------|----------------|----------------|
|   | bis        | 31.08.2023       | 31.08.2022     | 31.08.2021     | 31.08.2020     |
| <b>Konsolidiert</b>   |            |                  |                |                |                |
|   | <b>CHF</b> |                  |                |                |                |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode             |            | 1'010'395'016.73 | 894'537'480.25 | 759'924'468.36 | 680'200'027.74 |
| <b>Klasse A</b>   |            |                  |                |                |                |
|   | <b>CHF</b> |                  |                |                |                |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode             |            | 10'027'748.51    | 10'802'931.16  | 13'399'147.76  | 14'543'237.52  |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode                 |            | 115'533.694      | 126'451.901    | 138'385.671    | 150'054.350    |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) |            | 86.80            | 85.43          | 96.82          | 96.92          |
| Ausschüttung je Anteil                                      |            | 0.35             | 0.20           | 0.30           | 0.40           |
| Zwischenausschüttung je Anteil                              |            | -                | 0.10           | -              | -              |
| Total Expense Ratio (TER)                                   |            | 0.60 %           | 0.60 %         | 0.60 %         | 0.60 %         |
| <b>Klasse B</b>   |            |                  |                |                |                |
|   | <b>CHF</b> |                  |                |                |                |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode             |            | 1'996'055.89     | 2'748'448.45   | 3'194'973.66   | 3'499'320.58   |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode                 |            | 22'412.587       | 31'403.357     | 32'295.000     | 35'428.000     |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) |            | 89.06            | 87.52          | 98.93          | 98.77          |
| Thesaurierung je Anteil                                     |            | 0.36             | 0.18           | 0.37           | 0.43           |
| Zwischenausschüttung je Anteil                              |            | -                | 0.06           | -              | -              |
| Total Expense Ratio (TER)                                   |            | 0.60 %           | 0.60 %         | 0.60 %         | 0.60 %         |
| <b>Klasse It</b>  |            |                  |                |                |                |
|   | <b>CHF</b> |                  |                |                |                |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode             |            | 38'082'321.15    | 40'920'341.70  | 38'008'442.80  | 38'837'236.29  |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode                 |            | 404'021.292      | 442'950.292    | 364'915.644    | 374'467.375    |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) |            | 94.26            | 92.38          | 104.16         | 103.71         |
| Thesaurierung je Anteil                                     |            | 0.76             | 0.57           | 0.82           | 0.88           |
| Zwischenausschüttung je Anteil                              |            | -                | 0.09           | -              | -              |
| Total Expense Ratio (TER)                                   |            | 0.19 %           | 0.19 %         | 0.19 %         | 0.19 %         |
| <b>Klasse Nt</b>  |            |                  |                |                |                |
|   | <b>CHF</b> |                  |                |                |                |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode             |            | 960'288'891.18   | 840'065'758.94 | 705'321'904.14 | 623'320'233.35 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode                 |            | 10'065'807.340   | 8'992'948.544  | 6'704'304.667  | 5'956'389.809  |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) |            | 95.40            | 93.41          | 105.20         | 104.65         |
| Thesaurierung je Anteil                                     |            | 0.91             | 0.75           | 0.99           | 1.05           |
| Zwischenausschüttung je Anteil                              |            | -                | 0.07           | -              | -              |
| Total Expense Ratio (TER)                                   |            | 0.03 %           | 0.03 %         | 0.03 %         | 0.03 %         |

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



## Performance

|                    | 2022 / 2023 | 2022     | 2021    | 2020   |
|--------------------|-------------|----------|---------|--------|
| Klasse A           | 1.84 %      | -12.38 % | -2.31 % | 0.49 % |
| Klasse B           | 1.83 %      | -12.37 % | -2.31 % | 0.48 % |
| Klasse It          | 2.25 %      | -12.01 % | -1.91 % | 0.91 % |
| Klasse Nt          | 2.42 %      | -11.87 % | -1.76 % | 1.07 % |
| Benchmark          | 1.77 %      | -12.10 % | 1.82 %  | 0.90 % |
| Tracking Error 33) | 0.63 %      | 0.61 %   | 0.17 %  | 0.74 % |

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 A  | 0.07 % |
| Klasse B  | 0.06 % |
| Klasse It | 0.48 % |
| Klasse Nt | 0.65 % |

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

## Vermögensrechnung

| (Verkehrswerte)   | 31.08.2023              | 31.08.2022            |
|---|-------------------------|-----------------------|
| Bankguthaben auf Sicht  | 2'183'602.04            | 0.00                  |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 1'001'568'440.61        | 895'164'464.60        |
| Sonstige Vermögenswerte   | 6'679'568.00            | 5'150'833.33          |
| <b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>                         | <b>1'010'431'610.65</b> | <b>900'315'297.93</b> |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten  | 0.00                    | -5'739'889.04         |
| Andere Verbindlichkeiten  | -36'593.92              | -37'928.64            |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>                          | <b>1'010'395'016.73</b> | <b>894'537'480.25</b> |

## Entwicklung der Anzahl Anteile

|   | von<br>bis | 01.09.2022<br>31.08.2023 | 01.09.2021<br>31.08.2022 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| <b>Klasse A</b>                             |            |                          |                          |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode      |            | 126'451.901              | 138'385.671              |
| Ausgegebene Anteile                         |            | 1'995.000                | 1'200.000                |
| Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds  |            | -                        | 2'646.540                |
| Zurückgenommene Anteile                     |            | -12'913.207              | -15'780.310              |
| <b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b> |            | <b>115'533.694</b>       | <b>126'451.901</b>       |
| <b>Klasse B</b>                             |            |                          |                          |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode      |            | 31'403.357               | 32'295.000               |
| Ausgegebene Anteile                         |            | 225.362                  | 290.000                  |
| Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds  |            | -                        | 4'726.397                |
| Zurückgenommene Anteile                     |            | -9'216.132               | -5'908.040               |
| <b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b> |            | <b>22'412.587</b>        | <b>31'403.357</b>        |
| <b>Klasse It</b>                            |            |                          |                          |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode      |            | 442'950.292              | 364'915.644              |
| Ausgegebene Anteile                         |            | 4'740.000                | 14'920.000               |
| Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds  |            | -                        | 65'519.648               |
| Zurückgenommene Anteile                     |            | -43'669.000              | -2'405.000               |
| <b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b> |            | <b>404'021.292</b>       | <b>442'950.292</b>       |
| <b>Klasse Nt</b>                            |            |                          |                          |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode      |            | 8'992'948.544            | 6'704'304.667            |
| Ausgegebene Anteile                         |            | 1'010'116.766            | 877'935.756              |
| Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)          |            | 1'967'726.680            | 6'327.220                |
| Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds  |            | -                        | 3'810'402.334            |
| Zurückgenommene Anteile                     |            | -1'751'723.324           | -1'324'042.706           |
| Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)      |            | -153'261.326             | -1'081'978.727           |
| <b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b> |            | <b>10'065'807.340</b>    | <b>8'992'948.544</b>     |

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

|           | Datum      | Gegenwert      | Anteile       |
|-----------|------------|----------------|---------------|
| Klasse Nt | 28.09.2022 | 177'862'814.61 | 1'967'726.680 |

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

|           | Datum      | Gegenwert     | Anteile     |
|-----------|------------|---------------|-------------|
| Klasse Nt | 23.02.2023 | 14'149'085.62 | 153'261.326 |

## Veränderung des Nettofondsvermögens

|  | von<br>bis | 01.09.2022<br>31.08.2023 | 01.09.2021<br>31.08.2022 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| <b>Konsolidiert</b>                                    |            |                          |                          |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode      |            | 894'537'480.25           | 759'924'468.36           |
| Ausbezahlte Ausschüttung                               |            | -24'038.06               | -484'975.68              |
| Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer   |            | -2'934'129.29            | -2'180'420.42            |
| Saldo aus dem Anteilverkehr                            |            | 89'950'678.96            | 236'290'147.28           |
| Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung                       |            | 28'865'024.87            | -99'011'739.29           |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b> |            | <b>1'010'395'016.73</b>  | <b>894'537'480.25</b>    |

## Erfolgsrechnung

| Konsolidiert   | von<br>bis | 01.09.2022<br>31.08.2023 | 01.09.2021<br>31.08.2022 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| <b>Ertrag</b>  |            |                          |                          |
| Erträge der Bankguthaben auf Sicht   |            | 8'101.60                 | 0.00                     |
| Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht   |            | -1'378.70                | -45'389.70               |
| Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte |            | 10'110'045.67            | 7'266'061.16             |
| Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds-/anteilen                                       |            | 0.00                     | 1'291'885.56             |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen                                |            | 715'704.53               | 366'866.04               |
| <b>Total Ertrag</b>  |            | <b>10'832'473.10</b>     | <b>8'879'423.06</b>      |
| <b>Aufwand</b>   |            |                          |                          |
| Passivzinsen   |            | 0.00                     | -599.15                  |
| Reglementarische Vergütungen   |            | -431'466.13              | -399'955.27              |
| Sonstige Aufwendungen  |            | 0.00                     | -239.65                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen                            |            | -808'412.27              | -929'609.18              |
| <b>Total Aufwand</b>   |            | <b>-1'239'878.40</b>     | <b>-1'330'403.25</b>     |
| <b>Nettoertrag / Verlust</b>   |            | <b>9'592'594.70</b>      | <b>7'549'019.81</b>      |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   |            | -23'134'197.25           | -22'706'189.60           |
| Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen   |            | 630'891.04               | 333'493.37               |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   |            | <b>-12'910'711.51</b>    | <b>-14'823'676.42</b>    |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   |            | 41'775'736.38            | -84'188'062.87           |
| <b>Gesamterfolg</b>  |            | <b>28'865'024.87</b>     | <b>-99'011'739.29</b>    |

## Verwendung des Erfolges

| Klasse A   | 31.08.2023          | 31.08.2022          |
|--|---------------------|---------------------|
| Nettoertrag  | 40'424.43           | 29'244.29           |
| Vortrag des Vorjahres                                | 4'319.55            | 12'933.51           |
| Übertrag aus Vereinigung                             | 0.00                | 191.37              |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>             | <b>44'743.98</b>    | <b>42'369.17</b>    |
| Zwischenausschüttung                                 | 0.00                | 12'759.24           |
| Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg  | 40'436.79           | 25'290.38           |
| Vortrag auf neue Rechnung                            | 4'307.19            | 4'319.55            |
| <b>Total</b>   | <b>44'743.98</b>    | <b>42'369.17</b>    |
| <b>Klasse B</b>                                      | <b>31.08.2023</b>   | <b>31.08.2022</b>   |
| Nettoertrag  | 8'118.28            | 7'683.99            |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>             | <b>8'118.28</b>     | <b>7'683.99</b>     |
| Zwischenausschüttung                                 | 0.00                | 1'833.84            |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 2'841.40            | 2'047.55            |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage          | 5'276.88            | 3'802.60            |
| <b>Total</b>   | <b>8'118.28</b>     | <b>7'683.99</b>     |
| <b>Klasse It</b>                                     | <b>31.08.2023</b>   | <b>31.08.2022</b>   |
| Nettoertrag  | 307'057.15          | 287'502.13          |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>             | <b>307'057.15</b>   | <b>287'502.13</b>   |
| Zwischenausschüttung                                 | 0.00                | 33'968.76           |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 107'470.00          | 88'736.68           |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage          | 199'587.15          | 164'796.69          |
| <b>Total</b>   | <b>307'057.15</b>   | <b>287'502.13</b>   |
| <b>Klasse Nt</b>                                     | <b>31.08.2023</b>   | <b>31.08.2022</b>   |
| Nettoertrag  | 9'236'994.84        | 7'224'589.40        |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>             | <b>9'236'994.84</b> | <b>7'224'589.40</b> |
| Zwischenausschüttung                                 | 0.00                | 396'127.94          |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 3'232'948.19        | 2'389'961.51        |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage          | 6'004'046.65        | 4'438'499.95        |
| <b>Total</b>   | <b>9'236'994.84</b> | <b>7'224'589.40</b> |

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

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum   | Bezeichnung                         | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF         | in %<br>7)   | Kat. |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-------------------------|--------------|------|
| <b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>                                    |                                     |                                    |                      |                         |   |            | <b>1'001'568'440.61</b> | <b>99.12</b> |      |
| <b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b> |                                     |                                    |                      |                         |   |            | <b>1'001'568'440.61</b> | <b>99.12</b> |      |
| CH0025662831   | 3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN     | 5'000                              | 1'000                | 2'000                   | 4'000 CHF                                       | 102.95%    | 4'118'000.00            | 0.41         | a)   |
| CH1214797214   | 2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN  | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 101.05%    | 1'515'750.00            | 0.15         | a)   |
| CH1233900013   | 2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.35%    | 2'508'750.00            | 0.25         | a)   |
| CH1256367165   | 2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.75%    | 2'015'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH1274703151   | 2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN  | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.45%    | 1'506'750.00            | 0.15         | a)   |
| <b>AT</b>  |                                     |                                    |                      |                         |   |            | <b>11'664'250.00</b>    | <b>1.15</b>  |      |
| CH0327226863   | 0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN  | 0                                  | 2'000                | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0340912168   | 0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN   | 1'070                              | 0                    | 1'070                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0409606362   | 1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN      | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 97.35%     | 1'947'000.00            | 0.19         | a)   |
| CH0472691408   | 0.8000 % AMPAU 0.8 07/18/23 EMTN    | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0525158421   | 0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN | 2'400                              | 1'400                | 3'000                   | 800 CHF   | 95.72%     | 765'760.00              | 0.08         | a)   |
| CH1118483747   | 0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN  | 3'300                              | 1'400                | 1'950                   | 2'750 CHF                                       | 90.25%     | 2'481'875.00            | 0.25         | a)   |
| CH1213243871   | 1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29       | 0                                  | 5'000                | 0                       | 5'000 CHF                                       | 99.65%     | 4'982'500.00            | 0.49         | a)   |
| CH1271360385   | 2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30       | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 101.15%    | 2'023'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH1273475389   | 1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN   | 0                                  | 4'000                | 0                       | 4'000 CHF                                       | 100.70%    | 4'028'000.00            | 0.40         | a)   |
| <b>AU</b>  |                                     |                                    |                      |                         |   |            | <b>16'228'135.00</b>    | <b>1.61</b>  |      |
| CH0258404455   | 0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN      | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0305398254   | 0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN     | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 95.95%     | 959'500.00              | 0.09         | a)   |
| CH0343366800   | 0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31         | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0367206759   | 0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN    | 1'000                              | 1'000                | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH1117896477   | 0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN       | 8'500                              | 2'000                | 10'500                  | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH1137122771   | 0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN     | 2'300                              | 0                    | 500                     | 1'800 CHF                                       | 89.00%     | 1'602'000.00            | 0.16         | a)   |
| CH1221150480   | 1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN  | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 100.35%    | 3'010'500.00            | 0.30         | a)   |
| CH1242301302   | 1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 99.65%     | 1'993'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH1253456102   | 2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN     | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.85%    | 2'017'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH1261608892   | 2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.95%    | 2'019'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH1261608926   | 2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN   | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 102.10%    | 2'042'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH1279261122   | 1.9100 % CM 1.91 07/14/28           | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.30%    | 2'507'500.00            | 0.25         | a)   |
| CH1290870885   | 1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN      | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.34%    | 2'508'525.00            | 0.25         | a)   |
| <b>CA</b>  |                                     |                                    |                      |                         |   |            | <b>18'659'025.00</b>    | <b>1.85</b>  |      |
| CH0009755197   | 4.0000 % SWISS 4 01/06/49           | 2'254                              | 1'450                | 204                     | 3'500 CHF                                       | 169.60%    | 5'936'000.00            | 0.59         | a)   |
| CH0015803239   | 3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33       | 18'020                             | 3'800                | 6'820                   | 15'000 CHF                                      | 123.73%    | 18'559'500.00           | 1.84         | a)   |
| CH0024522747   | 2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26      | 4'000                              | 0                    | 2'000                   | 2'000 CHF                                       | 101.95%    | 2'039'000.00            | 0.20         | a)   |
| CH0024524966   | 2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36       | 7'100                              | 1'000                | 0                       | 8'100 CHF                                       | 118.38%    | 9'588'780.00            | 0.95         | a)   |
| CH0031835561   | 3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27       | 22'350                             | 4'300                | 22'650                  | 4'000 CHF                                       | 108.37%    | 4'334'800.00            | 0.43         | a)   |
| CH0109674488   | 3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25      | 5'050                              | 0                    | 0                       | 5'050 CHF                                       | 100.84%    | 5'092'420.00            | 0.50         | a)   |
| CH0114695403   | 1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25        | 2'500                              | 0                    | 2'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0117076379   | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524  | 15'000                             | 0                    | 0                       | 15'000 CHF                                      | 101.45%    | 15'217'500.00           | 1.51         | a)   |
| CH0119015086   | 2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405      | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0127181029   | 2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31       | 14'620                             | 3'500                | 620                     | 17'500 CHF                                      | 109.89%    | 19'230'750.00           | 1.90         | a)   |
| CH0127181169   | 1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42       | 300                                | 0                    | 0                       | 300 CHF   | 109.72%    | 329'160.00              | 0.03         | a)   |
| CH0127181193   | 1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37       | 20'555                             | 4'375                | 10'430                  | 14'500 CHF                                      | 103.87%    | 15'061'150.00           | 1.49         | a)   |
| CH0128891105   | 2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553  | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 103.15%    | 1'031'500.00            | 0.10         | a)   |
| CH0136847156   | 1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413  | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 99.92%     | 999'200.00              | 0.10         | a)   |
| CH0140819845   | 1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25      | 1'200                              | 0                    | 1'200                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0143808340   | 1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27        | 1'250                              | 1'000                | 0                       | 2'250 CHF                                       | 98.75%     | 2'221'875.00            | 0.22         | a)   |
| CH0149176163   | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564  | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                    | 0.00         |      |
| CH0149317056   | 1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32      | 5'000                              | 1'400                | 1'000                   | 5'400 CHF                                       | 99.65%     | 5'381'100.00            | 0.53         | a)   |
| CH0180428531   | 2.8750 % KWLILJ 2 7/8 03/27/42      | 1'560                              | 500                  | 0                       | 2'060 CHF                                       | 105.20%    | 2'167'120.00            | 0.21         | a)   |
| CH0185258222   | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423  | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 98.95%     | 2'968'500.00            | 0.29         | a)   |

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                        | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF | in %<br>7) | Kat. |
|----------------------------|------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0194273204               | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574 | 9'000                              | 0                    | 500                     | 8'500 CHF                                       | 98.13%     | 8'341'050.00    | 0.83       | a)   |
| CH0194695216               | 1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26     | 1'500                              | 0                    | 1'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0194958960               | 3.0000 % KWLILI 3 09/27/52         | 400                                | 0                    | 0                       | 400 CHF   | 109.70%    | 438'800.00      | 0.04       | a)   |
| CH0199543569               | 1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32     | 2'000                              | 100                  | 0                       | 2'100 CHF                                       | 98.35%     | 2'065'350.00    | 0.20       | a)   |
| CH0204811100               | 1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25     | 30                                 | 0                    | 30                      | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0206992270               | 1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27     | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0208271541               | 3.0000 % KWLILI 3 04/02/48         | 1'030                              | 400                  | 0                       | 1'430 CHF                                       | 108.75%    | 1'555'125.00    | 0.15       | a)   |
| CH0209002341               | 1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28     | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 99.00%     | 990'000.00      | 0.10       | a)   |
| CH0222000413               | 2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33     | 0                                  | 1'850                | 0                       | 1'850 CHF                                       | 104.85%    | 1'939'725.00    | 0.19       | a)   |
| CH0224396983               | 1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26      | 5'600                              | 0                    | 5'600                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0224397007               | 2.0000 % SWISS 2 06/25/64          | 3'200                              | 750                  | 0                       | 3'950 CHF                                       | 143.49%    | 5'667'855.00    | 0.56       | a)   |
| CH0224397171               | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30      | 19'510                             | 6'600                | 8'610                   | 17'500 CHF                                      | 97.23%     | 17'015'250.00   | 1.68       | a)   |
| CH0224397338               | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58      | 5'100                              | 750                  | 0                       | 5'850 CHF                                       | 89.44%     | 5'232'240.00    | 0.52       | a)   |
| CH0224397346               | 0.0000 % SWISS 0 06/22/29          | 8'380                              | 300                  | 2'680                   | 6'000 CHF                                       | 94.73%     | 5'683'800.00    | 0.56       | a)   |
| CH0241926317               | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593 | 3'000                              | 0                    | 250                     | 2'750 CHF                                       | 99.37%     | 2'732'675.00    | 0.27       | a)   |
| CH0244692536               | 2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24     | 5'770                              | 400                  | 3'170                   | 3'000 CHF                                       | 99.97%     | 2'999'100.00    | 0.30       | a)   |
| CH0245691537               | 1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24     | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 99.57%     | 995'700.00      | 0.10       | a)   |
| CH0245863987               | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450 | 5'000                              | 0                    | 1'700                   | 3'300 CHF                                       | 99.30%     | 3'276'900.00    | 0.32       | a)   |
| CH0248890490               | 2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24     | 6'630                              | 750                  | 380                     | 7'000 CHF                                       | 100.20%    | 7'014'000.00    | 0.69       | a)   |
| CH0253612581               | 1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27         | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0254212233               | 1.0000 % ZURICH 1 10/06/27         | 700                                | 0                    | 700                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0255678333               | 1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598     | 1'500                              | 0                    | 1'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0263432988               | 1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459     | 0                                  | 1'500                | 1'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0264227015               | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603 | 1'500                              | 0                    | 1'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0270190991               | 0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29     | 3'000                              | 1'000                | 300                     | 3'700 CHF                                       | 94.00%     | 3'478'000.00    | 0.34       | a)   |
| CH0271288547               | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605 | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 94.61%     | 2'838'300.00    | 0.28       | a)   |
| CH0271819812               | 0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27     | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0278341224               | 1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN        | 6'000                              | 1'950                | 7'950                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0278667115               | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464 | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 92.60%     | 1'389'000.00    | 0.14       | a)   |
| CH0280569135               | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610 | 7'500                              | 3'000                | 2'000                   | 8'500 CHF                                       | 90.05%     | 7'654'250.00    | 0.76       | a)   |
| CH0280737542               | 0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52     | 0                                  | 5'000                | 0                       | 5'000 CHF                                       | 92.65%     | 4'632'500.00    | 0.46       | a)   |
| CH0285509334               | 2.1250 % ALPHSW 2 1/8 06/30/23     | 1'500                              | 0                    | 1'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0291625231               | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616 | 10'000                             | 0                    | 0                       | 10'000 CHF                                      | 96.73%     | 9'673'000.00    | 0.96       | a)   |
| CH0297132349               | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618 | 4'000                              | 0                    | 0                       | 4'000 CHF                                       | 97.10%     | 3'884'000.00    | 0.38       | a)   |
| CH0297132364               | 1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619     | 10'000                             | 0                    | 0                       | 10'000 CHF                                      | 92.50%     | 9'250'000.00    | 0.92       | a)   |
| CH0305765775               | 0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27       | 3'830                              | 1'200                | 0                       | 5'030 CHF                                       | 94.15%     | 4'735'745.00    | 0.47       | a)   |
| CH0307256427               | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475 | 2'200                              | 0                    | 0                       | 2'200 CHF                                       | 93.70%     | 2'061'400.00    | 0.20       | a)   |
| CH0312512681               | 0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25     | 2'245                              | 1'000                | 1'245                   | 2'000 CHF                                       | 97.70%     | 1'954'000.00    | 0.19       | a)   |
| CH0312512715               | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478 | 60                                 | 0                    | 60                      | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0319403744               | 0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480  | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0319403751               | 0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138    | 3'040                              | 2'000                | 2'040                   | 3'000 CHF                                       | 95.50%     | 2'865'000.00    | 0.28       | a)   |
| CH0319932767               | 0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31       | 150                                | 0                    | 150                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0323735628               | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631 | 3'000                              | 500                  | 0                       | 3'500 CHF                                       | 93.52%     | 3'273'200.00    | 0.32       | a)   |
| CH0330143147               | 1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24     | 4'650                              | 1'000                | 1'650                   | 4'000 CHF                                       | 99.65%     | 3'986'000.00    | 0.39       | a)   |
| CH0336587719               | 0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483     | 5'100                              | 0                    | 0                       | 5'100 CHF                                       | 94.22%     | 4'805'220.00    | 0.48       | a)   |
| CH0337172313               | 0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31       | 400                                | 0                    | 400                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0337645581               | 0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485     | 12'000                             | 0                    | 12'000                  | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0342587638               | 0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140     | 4'000                              | 0                    | 0                       | 4'000 CHF                                       | 94.45%     | 3'778'000.00    | 0.37       | a)   |
| CH0344958472               | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55      | 1'250                              | 0                    | 0                       | 1'250 CHF                                       | 89.36%     | 1'117'000.00    | 0.11       | a)   |
| CH0344958498               | 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45      | 5'680                              | 1'250                | 5'600                   | 1'330 CHF                                       | 91.51%     | 1'217'083.00    | 0.12       | a)   |
| CH0347556927               | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645 | 5'000                              | 0                    | 0                       | 5'000 CHF                                       | 87.70%     | 4'385'000.00    | 0.43       | a)   |
| CH0353945378               | 0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26      | 4'000                              | 0                    | 0                       | 4'000 CHF                                       | 95.60%     | 3'824'000.00    | 0.38       | a)   |
| CH0357483160               | 2.0000 % KWLILI 2 12/11/23         | 2'700                              | 0                    | 0                       | 2'700 CHF                                       | 99.98%     | 2'699'460.00    | 0.27       | a)   |
| CH0357676169               | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492 | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0357676177               | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493 | 3'500                              | 0                    | 0                       | 3'500 CHF                                       | 93.14%     | 3'259'900.00    | 0.32       | a)   |
| CH0358654975               | 0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024    | 0                                  | 500                  | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0361532820               | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494 | 100                                | 0                    | 100                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0361532879               | 0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29     | 3'000                              | 900                  | 900                     | 3'000 CHF                                       | 93.35%     | 2'800'500.00    | 0.28       | a)   |
| CH0361532952               | 1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24     | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 99.12%     | 991'200.00      | 0.10       | a)   |
| CH0361533166               | 0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57       | 2'100                              | 500                  | 0                       | 2'600 CHF                                       | 89.45%     | 2'325'700.00    | 0.23       | a)   |
| CH0362748342               | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649 | 0                                  | 100                  | 100                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                        | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF | in %<br>7) | Kat. |
|----------------------------|------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0370943547               | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651 | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 95.43%     | 954'300.00      | 0.09       | a)   |
| CH0373476370               | 0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35     | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 89.50%     | 1'790'000.00    | 0.18       | a)   |
| CH0373476677               | 0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143    | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0373476693               | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501 | 5'500                              | 0                    | 0                       | 5'500 CHF                                       | 94.10%     | 5'175'500.00    | 0.51       | a)   |
| CH0373476768               | 1.2500 % GRANDX 1 1/4 06/06/23     | 2'000                              | 0                    | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0384125065               | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654 | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 95.60%     | 1'912'000.00    | 0.19       | a)   |
| CH0391648018               | 1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25      | 5'250                              | 1'000                | 1'250                   | 5'000 CHF                                       | 99.00%     | 4'950'000.00    | 0.49       | a)   |
| CH0398633484               | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504 | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 95.74%     | 957'400.00      | 0.09       | a)   |
| CH0398633492               | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505 | 0                                  | 800                  | 0                       | 800 CHF   | 91.84%     | 734'720.00      | 0.07       | a)   |
| CH0398633575               | 0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507 | 5'000                              | 0                    | 0                       | 5'000 CHF                                       | 94.58%     | 4'729'000.00    | 0.47       | a)   |
| CH0398633922               | 0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32     | 300                                | 0                    | 300                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0405986057               | 0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25     | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0406415262               | 0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25      | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0407153359               | 0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN  | 2'000                              | 0                    | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0411478099               | 0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27       | 2'050                              | 0                    | 0                       | 2'050 CHF                                       | 94.75%     | 1'942'375.00    | 0.19       | a)   |
| CH0419040784               | 0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27       | 4'200                              | 1'000                | 1'500                   | 3'700 CHF                                       | 94.10%     | 3'481'700.00    | 0.34       | a)   |
| CH0419040800               | 0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29      | 5'000                              | 0                    | 2'000                   | 3'000 CHF                                       | 92.90%     | 2'787'000.00    | 0.28       | a)   |
| CH0419040842               | 0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508  | 10'000                             | 0                    | 0                       | 10'000 CHF                                      | 92.10%     | 9'210'000.00    | 0.91       | a)   |
| CH0419041006               | 0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27        | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 94.25%     | 1'885'000.00    | 0.19       | a)   |
| CH0419041071               | 0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27     | 9'000                              | 1'000                | 3'000                   | 7'000 CHF                                       | 95.95%     | 6'716'500.00    | 0.66       | a)   |
| CH0419041147               | 0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30       | 11'750                             | 2'500                | 1'750                   | 12'500 CHF                                      | 91.20%     | 11'400'000.00   | 1.13       | a)   |
| CH0419041337               | 0.0000 % VALIAN 0 07/31/29         | 1'300                              | 1'000                | 0                       | 2'300 CHF                                       | 89.75%     | 2'064'250.00    | 0.20       | a)   |
| CH0419041378               | 0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29     | 3'500                              | 1'300                | 250                     | 4'550 CHF                                       | 91.45%     | 4'160'975.00    | 0.41       | a)   |
| CH0419041436               | 0.0000 % KBAARG 0 09/17/29         | 3'000                              | 0                    | 0                       | 3'000 CHF                                       | 89.55%     | 2'686'500.00    | 0.27       | a)   |
| CH0419041584               | 0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41       | 3'000                              | 1'000                | 0                       | 4'000 CHF                                       | 73.65%     | 2'946'000.00    | 0.29       | a)   |
| CH0419042533               | 1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23        | 1'250                              | 1'000                | 2'250                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0423233516               | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659 | 1'500                              | 0                    | 0                       | 1'500 CHF                                       | 96.71%     | 1'450'650.00    | 0.14       | a)   |
| CH0423233524               | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660 | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 93.86%     | 1'877'200.00    | 0.19       | a)   |
| CH0428194275               | 0.7500 % VIFNVX 0 3/4 09/13/22     | 3'000                              | 0                    | 3'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0434678428               | 1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24        | 6'500                              | 1'000                | 6'000                   | 1'500 CHF                                       | 99.23%     | 1'488'450.00    | 0.15       | a)   |
| CH0434678444               | 1.0000 % HIAGSW 1 10/26/22         | 3'025                              | 1'500                | 4'525                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0440081401               | 0.0000 % SWISS 0 07/24/39          | 500                                | 0                    | 0                       | 500 CHF   | 85.96%     | 429'800.00      | 0.04       | a)   |
| CH0461239045               | 0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146     | 2'000                              | 1'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 87.60%     | 2'628'000.00    | 0.26       | a)   |
| CH0461239086               | 0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31        | 3'500                              | 1'000                | 0                       | 4'500 CHF                                       | 88.00%     | 3'960'000.00    | 0.39       | a)   |
| CH0465044649               | 0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28       | 5'980                              | 1'750                | 1'730                   | 6'000 CHF                                       | 93.20%     | 5'592'000.00    | 0.55       | a)   |
| CH0471297926               | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671 | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 91.25%     | 1'825'000.00    | 0.18       | a)   |
| CH0471297983               | 0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24     | 1'000                              | 500                  | 0                       | 1'500 CHF                                       | 98.99%     | 1'484'850.00    | 0.15       | a)   |
| CH0485252818               | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676 | 3'800                              | 1'875                | 2'175                   | 3'500 CHF                                       | 86.15%     | 3'015'250.00    | 0.30       | a)   |
| CH0494734426               | 0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25       | 830                                | 0                    | 830                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0506071114               | 0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30         | 2'500                              | 1'000                | 0                       | 3'500 CHF                                       | 88.95%     | 3'113'250.00    | 0.31       | a)   |
| CH0506071221               | 0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147        | 4'500                              | 2'000                | 0                       | 6'500 CHF                                       | 88.95%     | 5'781'750.00    | 0.57       | a)   |
| CH0506071270               | 0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30      | 2'600                              | 1'000                | 0                       | 3'600 CHF                                       | 89.25%     | 3'213'000.00    | 0.32       | a)   |
| CH0506071353               | 0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31         | 6'000                              | 0                    | 3'500                   | 2'500 CHF                                       | 87.40%     | 2'185'000.00    | 0.22       | a)   |
| CH0506071379               | 0.2500 % AMALEA 0 1/4 10/27/23     | 1'750                              | 0                    | 0                       | 1'750 CHF                                       | 99.68%     | 1'744'400.00    | 0.17       | a)   |
| CH0506071387               | 0.0000 % VALIAN 0 01/20/26         | 7'150                              | 1'800                | 0                       | 8'950 CHF                                       | 95.50%     | 8'547'250.00    | 0.85       | a)   |
| CH0520663581               | 0.0000 % CS 0 07/31/25 EMTN        | 2'000                              | 500                  | 0                       | 2'500 CHF                                       | 96.00%     | 2'400'000.00    | 0.24       | a)   |
| CH0522158952               | 0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33       | 7'000                              | 1'700                | 500                     | 8'200 CHF                                       | 84.25%     | 6'908'500.00    | 0.68       | a)   |
| CH0522159034               | 1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42         | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 99.20%     | 992'000.00      | 0.10       | a)   |
| CH0525158397               | 0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683     | 7'000                              | 1'150                | 2'000                   | 6'150 CHF                                       | 92.80%     | 5'707'200.00    | 0.56       | a)   |
| CH0528881169               | 0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30         | 8'000                              | 3'000                | 2'000                   | 9'000 CHF                                       | 89.85%     | 8'086'500.00    | 0.80       | a)   |
| CH0536892612               | 0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24       | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0536892620               | 1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23         | 3'700                              | 0                    | 0                       | 3'700 CHF                                       | 99.69%     | 3'688'530.00    | 0.37       | a)   |
| CH0536892703               | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519 | 100                                | 0                    | 100                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0536892901               | 0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523   | 2'500                              | 500                  | 500                     | 2'500 CHF                                       | 84.25%     | 2'106'250.00    | 0.21       | a)   |
| CH0536893198               | 0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524     | 0                                  | 500                  | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0537261924               | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686 | 1'500                              | 0                    | 0                       | 1'500 CHF                                       | 93.98%     | 1'409'700.00    | 0.14       | a)   |
| CH0539032943               | 1.0500 % GVAERO 1.05 05/26/23      | 3'200                              | 400                  | 3'600                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0550413360               | 0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN    | 7'900                              | 1'000                | 400                     | 8'500 CHF                                       | 91.45%     | 7'773'250.00    | 0.77       | a)   |
| CH0553331809               | 1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25      | 5'300                              | 1'500                | 300                     | 6'500 CHF                                       | 97.65%     | 6'347'250.00    | 0.63       | a)   |
| CH0553331858               | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690 | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0557778310               | 0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35      | 0                                  | 900                  | 0                       | 900 CHF   | 92.30%     | 830'700.00      | 0.08       | a)   |

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                        | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF | in %<br>7) | Kat. |
|----------------------------|------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0570576113               | 0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29     | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 93.50%     | 935'000.00      | 0.09       | a)   |
| CH0572899091               | 0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25    | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH0572899257               | 0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28     | 3'000                              | 500                  | 500                     | 3'000 CHF                                       | 90.85%     | 2'725'500.00    | 0.27       | a)   |
| CH0576402165               | 0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27      | 3'000                              | 0                    | 0                       | 3'000 CHF                                       | 95.20%     | 2'856'000.00    | 0.28       | a)   |
| CH0581947733               | 0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29      | 2'250                              | 1'000                | 1'000                   | 2'250 CHF                                       | 89.80%     | 2'020'500.00    | 0.20       | a)   |
| CH0589030946               | 0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149        | 900                                | 400                  | 0                       | 1'300 CHF                                       | 84.50%     | 1'098'500.00    | 0.11       | a)   |
| CH0589030979               | 0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25     | 4'750                              | 1'000                | 2'250                   | 3'500 CHF                                       | 96.85%     | 3'389'750.00    | 0.34       | a)   |
| CH0589031126               | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533 | 2'400                              | 0                    | 0                       | 2'400 CHF                                       | 83.95%     | 2'014'800.00    | 0.20       | a)   |
| CH0591084253               | 0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31      | 2'200                              | 700                  | 0                       | 2'900 CHF                                       | 87.30%     | 2'531'700.00    | 0.25       | a)   |
| CH0593893990               | 0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31      | 3'250                              | 800                  | 500                     | 3'550 CHF                                       | 91.50%     | 3'248'250.00    | 0.32       | a)   |
| CH0598928718               | 0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29        | 200                                | 0                    | 200                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1101096514               | 0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35     | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 83.65%     | 836'500.00      | 0.08       | a)   |
| CH1101096522               | 0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534     | 11'900                             | 2'000                | 1'900                   | 12'000 CHF                                      | 92.60%     | 11'112'000.00   | 1.10       | a)   |
| CH1105672708               | 0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26     | 1'300                              | 500                  | 1'800                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1105672724               | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701 | 3'500                              | 0                    | 1'000                   | 2'500 CHF                                       | 88.75%     | 2'218'750.00    | 0.22       | a)   |
| CH1105672740               | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703 | 0                                  | 1'100                | 1'100                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1111392861               | 0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31       | 5'500                              | 1'000                | 0                       | 6'500 CHF                                       | 87.30%     | 5'674'500.00    | 0.56       | a)   |
| CH1112455790               | 0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25     | 3'000                              | 1'250                | 3'250                   | 1'000 CHF                                       | 95.10%     | 951'000.00      | 0.09       | a)   |
| CH1115424678               | 0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26       | 3'555                              | 1'000                | 500                     | 4'055 CHF                                       | 95.50%     | 3'872'525.00    | 0.38       | a)   |
| CH1118223408               | 0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30      | 1'000                              | 700                  | 0                       | 1'700 CHF                                       | 87.95%     | 1'495'150.00    | 0.15       | a)   |
| CH1118223424               | 0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537   | 8'100                              | 1'300                | 0                       | 9'400 CHF                                       | 86.90%     | 8'168'600.00    | 0.81       | a)   |
| CH1118223523               | 0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN    | 1'000                              | 1'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 86.65%     | 1'733'000.00    | 0.17       | a)   |
| CH1120085670               | 0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN    | 0                                  | 650                  | 650                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1122290211               | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705 | 10'000                             | 0                    | 0                       | 10'000 CHF                                      | 78.70%     | 7'870'000.00    | 0.78       | a)   |
| CH1129053794               | 0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33     | 8'000                              | 1'500                | 5'000                   | 4'500 CHF                                       | 83.65%     | 3'764'250.00    | 0.37       | a)   |
| CH1129053810               | 0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33      | 4'250                              | 1'250                | 0                       | 5'500 CHF                                       | 82.65%     | 4'545'750.00    | 0.45       | a)   |
| CH1131931250               | 0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539     | 2'300                              | 0                    | 0                       | 2'300 CHF                                       | 80.50%     | 1'851'500.00    | 0.18       | a)   |
| CH1131931284               | 0.3500 % KSBAAAR 0.35 09/30/36     | 2'500                              | 700                  | 0                       | 3'200 CHF                                       | 78.15%     | 2'500'800.00    | 0.25       | a)   |
| CH1131931292               | 0.0000 % SWISSG 0 06/30/26         | 4'000                              | 0                    | 1'000                   | 3'000 CHF                                       | 94.90%     | 2'847'000.00    | 0.28       | a)   |
| CH1131931318               | 0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33       | 2'000                              | 700                  | 0                       | 2'700 CHF                                       | 86.00%     | 2'322'000.00    | 0.23       | a)   |
| CH1131931326               | 0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29       | 3'000                              | 1'000                | 0                       | 4'000 CHF                                       | 88.80%     | 3'552'000.00    | 0.35       | a)   |
| CH1132966354               | 0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29     | 5'050                              | 1'450                | 1'500                   | 5'000 CHF                                       | 88.20%     | 4'410'000.00    | 0.44       | a)   |
| CH1137122755               | 0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25      | 2'500                              | 750                  | 1'250                   | 2'000 CHF                                       | 96.10%     | 1'922'000.00    | 0.19       | a)   |
| CH1139995778               | 0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24      | 7'300                              | 2'000                | 6'400                   | 2'900 CHF                                       | 98.25%     | 2'849'250.00    | 0.28       | a)   |
| CH1141700521               | 0.0000 % AMALEA 0 02/18/25         | 3'450                              | 800                  | 0                       | 4'250 CHF                                       | 96.82%     | 4'114'850.00    | 0.41       | a)   |
| CH1141700547               | 0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26       | 3'500                              | 750                  | 2'750                   | 1'500 CHF                                       | 93.85%     | 1'407'750.00    | 0.14       | a)   |
| CH1141944459               | 0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62      | 1'800                              | 500                  | 0                       | 2'300 CHF                                       | 65.65%     | 1'509'950.00    | 0.15       | a)   |
| CH1145096165               | 0.4350 % UBS 0.435 11/09/28        | 7'400                              | 200                  | 0                       | 7'600 CHF                                       | 90.70%     | 6'893'200.00    | 0.68       | a)   |
| CH1148308724               | 0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27     | 850                                | 500                  | 1'350                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1148728129               | 0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32      | 4'500                              | 1'000                | 0                       | 5'500 CHF                                       | 85.25%     | 4'688'750.00    | 0.46       | a)   |
| CH1148728269               | 0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545  | 0                                  | 850                  | 0                       | 850 CHF   | 92.21%     | 783'785.00      | 0.08       | a)   |
| CH1151526154               | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710 | 4'500                              | 1'250                | 750                     | 5'000 CHF                                       | 88.05%     | 4'402'500.00    | 0.44       | a)   |
| CH1151526196               | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712 | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 83.97%     | 1'679'400.00    | 0.17       | a)   |
| CH1151526204               | 1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52     | 8'000                              | 2'000                | 0                       | 10'000 CHF                                      | 86.09%     | 8'608'600.00    | 0.85       | a)   |
| CH1154887132               | 0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26     | 7'800                              | 1'850                | 9'650                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1160188343               | 0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27     | 1'000                              | 1'200                | 350                     | 1'850 CHF                                       | 94.50%     | 1'748'250.00    | 0.17       | a)   |
| CH1166151899               | 0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27       | 7'800                              | 1'500                | 7'500                   | 1'800 CHF                                       | 95.85%     | 1'725'300.00    | 0.17       | a)   |
| CH1166151907               | 0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31       | 2'200                              | 0                    | 500                     | 1'700 CHF                                       | 92.85%     | 1'578'450.00    | 0.16       | a)   |
| CH1166151915               | 1.0000 % ROSW 1 02/25/37           | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 89.65%     | 1'793'000.00    | 0.18       | a)   |
| CH1167134845               | 0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58      | 1'800                              | 350                  | 0                       | 2'150 CHF                                       | 72.30%     | 1'554'450.00    | 0.15       | a)   |
| CH1168499775               | 0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27     | 9'500                              | 1'900                | 11'400                  | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1170565803               | 1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551   | 7'000                              | 1'000                | 0                       | 8'000 CHF                                       | 97.30%     | 7'784'000.00    | 0.77       | a)   |
| CH1170565811               | 1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552  | 18'800                             | 3'000                | 1'500                   | 20'300 CHF                                      | 96.39%     | 19'567'170.00   | 1.94       | a)   |
| CH1172972825               | 1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26      | 2'500                              | 0                    | 0                       | 2'500 CHF                                       | 97.05%     | 2'426'250.00    | 0.24       | a)   |
| CH1179534933               | 1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29      | 1'710                              | 340                  | 2'050                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1189217826               | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553 | 3'500                              | 0                    | 0                       | 3'500 CHF                                       | 98.86%     | 3'460'100.00    | 0.34       | a)   |
| CH1191066237               | 1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52     | 7'680                              | 1'500                | 0                       | 9'180 CHF                                       | 99.25%     | 9'111'150.00    | 0.90       | a)   |
| CH1193213076               | 1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001   | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 99.80%     | 1'996'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1194355074               | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723 | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 115.20%    | 1'152'000.00    | 0.11       | a)   |
| CH1194355124               | 2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34     | 1'200                              | 500                  | 0                       | 1'700 CHF                                       | 107.00%    | 1'819'000.00    | 0.18       | a)   |
| CH1206367422               | 1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560  | 4'000                              | 0                    | 0                       | 4'000 CHF                                       | 102.51%    | 4'100'400.00    | 0.41       | a)   |

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                           | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF | in %<br>7) | Kat. |
|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1206367463               | 1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27         | 0                                  | 3'000                | 1'000                   | 2'000 CHF                                       | 99.70%     | 1'994'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1206367497               | 3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 103.95%    | 2'079'000.00    | 0.21       | a)   |
| CH1206367539               | 2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562      | 0                                  | 6'150                | 1'150                   | 5'000 CHF                                       | 104.61%    | 5'230'500.00    | 0.52       | a)   |
| CH1206367554               | 3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27       | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 102.90%    | 2'572'500.00    | 0.25       | a)   |
| CH1206367588               | 2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564    | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 102.85%    | 3'085'500.00    | 0.31       | a)   |
| CH1206367596               | 2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565     | 0                                  | 1'200                | 0                       | 1'200 CHF                                       | 108.50%    | 1'302'000.00    | 0.13       | a)   |
| CH1211713164               | 1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32         | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 99.70%     | 1'994'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1211713214               | 2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34        | 0                                  | 2'900                | 200                     | 2'700 CHF                                       | 101.95%    | 2'752'650.00    | 0.27       | a)   |
| CH1214797131               | 2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728        | 0                                  | 10'000               | 0                       | 10'000 CHF                                      | 103.10%    | 10'310'000.00   | 1.02       | a)   |
| CH1214797164               | 2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27<br>EMTN | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 100.45%    | 3'013'500.00    | 0.30       | a)   |
| CH1218301955               | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730    | 0                                  | 3'500                | 2'000                   | 1'500 CHF                                       | 103.58%    | 1'553'700.00    | 0.15       | a)   |
| CH1226543879               | 2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28         | 0                                  | 2'225                | 500                     | 1'725 CHF                                       | 102.25%    | 1'763'812.50    | 0.17       | a)   |
| CH1228837865               | 2.3300 % UBS 2.33 11/14/25            | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 100.40%    | 3'012'000.00    | 0.30       | a)   |
| CH1230759479               | 2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24         | 0                                  | 1'660                | 0                       | 1'660 CHF                                       | 100.41%    | 1'666'806.00    | 0.16       | a)   |
| CH1232107073               | 1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38         | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 99.90%     | 2'497'500.00    | 0.25       | a)   |
| CH1239464659               | 1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68         | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 106.30%    | 2'126'000.00    | 0.21       | a)   |
| CH1239464667               | 2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58          | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 116.85%    | 1'168'500.00    | 0.12       | a)   |
| CH1239464691               | 3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28            | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 102.70%    | 1'540'500.00    | 0.15       | a)   |
| CH1239464733               | 2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572     | 0                                  | 2'450                | 0                       | 2'450 CHF                                       | 102.61%    | 2'513'945.00    | 0.25       | a)   |
| CH1239464816               | 2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28        | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.40%    | 1'506'000.00    | 0.15       | a)   |
| CH1239494995               | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733    | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 101.65%    | 3'049'500.00    | 0.30       | a)   |
| CH1242301286               | 2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32         | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 104.85%    | 1'572'750.00    | 0.16       | a)   |
| CH1243651945               | 2.7500 % KWLIL 2 3/4 03/01/30         | 0                                  | 1'200                | 0                       | 1'200 CHF                                       | 102.70%    | 1'232'400.00    | 0.12       | a)   |
| CH1243651994               | 2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29          | 0                                  | 1'870                | 0                       | 1'870 CHF                                       | 100.75%    | 1'884'025.00    | 0.19       | a)   |
| CH1249415998               | 2.4586 % CS 2.4586 11/22/24 EMTN      | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 100.40%    | 3'012'000.00    | 0.30       | a)   |
| CH1251030123               | 3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27        | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 102.50%    | 1'537'500.00    | 0.15       | a)   |
| CH1251998220               | 2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30         | 0                                  | 400                  | 0                       | 400 CHF   | 101.40%    | 405'600.00      | 0.04       | a)   |
| CH1255924396               | 2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30            | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.25%    | 2'506'250.00    | 0.25       | a)   |
| CH1255924404               | 2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27          | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.80%    | 1'512'000.00    | 0.15       | a)   |
| CH1255924412               | 3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 103.15%    | 2'063'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1255924438               | 2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739        | 0                                  | 825                  | 0                       | 825 CHF   | 104.63%    | 863'197.50      | 0.09       | a)   |
| CH1255924446               | 3.0000 % REGEMM 3 04/16/27            | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 102.25%    | 1'022'500.00    | 0.10       | a)   |
| CH1255924453               | 2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29         | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 101.90%    | 1'019'000.00    | 0.10       | a)   |
| CH1255924479               | 2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29 APR      | 0                                  | 1'870                | 1'870                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1256367199               | 2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33         | 0                                  | 1'100                | 0                       | 1'100 CHF                                       | 102.85%    | 1'131'350.00    | 0.11       | a)   |
| CH1264887360               | 2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 MAY        | 0                                  | 825                  | 825                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1264887378               | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 MAY    | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1264887428               | 3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31 JULY   | 0                                  | 2'000                | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1264887436               | 2.9500 % SPIMAE 2.95 07/13/26         | 0                                  | 1'250                | 0                       | 1'250 CHF                                       | 101.60%    | 1'270'000.00    | 0.13       | a)   |
| CH1266846992               | 2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26        | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 100.50%    | 1'005'000.00    | 0.10       | a)   |
| CH1266847073               | 2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38         | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 103.35%    | 1'033'500.00    | 0.10       | a)   |
| CH1266847123               | 2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN     | 0                                  | 1'200                | 1'200                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00            | 0.00       |      |
| CH1266847172               | 2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38           | 0                                  | 1'250                | 0                       | 1'250 CHF                                       | 103.80%    | 1'297'500.00    | 0.13       | a)   |
| CH1266847180               | 1.7000 % EGW 1.7 07/20/43 69          | 0                                  | 1'200                | 0                       | 1'200 CHF                                       | 101.95%    | 1'223'400.00    | 0.12       | a)   |
| CH1266847271               | 1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578     | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 102.10%    | 2'042'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1268922205               | 2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26        | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 99.95%     | 1'499'250.00    | 0.15       | a)   |
| CH1273475413               | 2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38        | 0                                  | 940                  | 0                       | 940 CHF   | 104.30%    | 980'420.00      | 0.10       | a)   |
| CH1276313256               | 2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740        | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 105.10%    | 1'576'500.00    | 0.16       | a)   |
| CH1276313264               | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741    | 0                                  | 3'000                | 0                       | 3'000 CHF                                       | 106.01%    | 3'180'300.00    | 0.31       | a)   |
| CH1276313272               | 3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25           | 0                                  | 1'250                | 0                       | 1'250 CHF                                       | 100.75%    | 1'259'375.00    | 0.12       | a)   |
| CH1276313330               | 2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31         | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 101.20%    | 2'024'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1279261163               | 1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44          | 0                                  | 1'050                | 0                       | 1'050 CHF                                       | 103.50%    | 1'086'750.00    | 0.11       | a)   |
| CH1280154290               | 1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744    | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 103.57%    | 2'071'400.00    | 0.21       | a)   |
| CH1280155461               | 1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33          | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 99.90%     | 1'998'000.00    | 0.20       | a)   |
| CH1280994315               | 3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29       | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.80%    | 1'512'000.00    | 0.15       | a)   |
| CH1290222293               | 2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30          | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 101.02%    | 2'525'400.00    | 0.25       | a)   |
| CH1290222319               | 2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.99%    | 2'019'840.00    | 0.20       | a)   |
| CH1290222335               | 2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28       | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 99.90%     | 1'498'545.00    | 0.15       | a)   |
| CH1290870877               | 2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33        | 0                                  | 1'200                | 0                       | 1'200 CHF                                       | 101.42%    | 1'217'016.00    | 0.12       | a)   |
| CH1290870901               | 2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28         | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 100.21%    | 1'002'080.00    | 0.10       | a)   |
| CH1293237975               | 1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.44%    | 2'008'820.00    | 0.20       | a)   |



| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                             | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF       | in %<br>7)   | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------------|--------------|------|
| <b>CH</b>                  |   |                                    |                      |                         |   |            | <b>735'097'795.00</b> | <b>72.75</b> |      |
| CH0517825300               | 0.6000 % TANNER 0.6 11/07/22            | 3'300                              | 1'000                | 4'300                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH1137122789               | 1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN      | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 97.68%     | 976'800.00            | 0.10         | a)   |
| CH1139995802               | 0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN     | 2'650                              | 550                  | 0                       | 3'200 CHF                                       | 91.75%     | 2'936'000.00          | 0.29         | a)   |
| CH1142700363               | 0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26<br>EMTN | 6'500                              | 1'600                | 1'900                   | 6'200 CHF                                       | 92.85%     | 5'756'700.00          | 0.57         | a)   |
| CH1248666963               | 2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN     | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.20%    | 1'503'000.00          | 0.15         | a)   |
| CH1264823472               | 2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25<br>EMTN  | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.90%    | 1'513'500.00          | 0.15         | a)   |
| <b>CL</b>                  |   |                                    |                      |                         |   |            | <b>12'686'000.00</b>  | <b>1.26</b>  |      |
| CH0273925989               | 0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN         | 2'180                              | 0                    | 0                       | 2'180 CHF                                       | 99.40%     | 2'166'920.00          | 0.21         | a)   |
| CH0386949314               | 0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32<br>EMTN   | 700                                | 0                    | 0                       | 700 CHF   | 89.40%     | 625'800.00            | 0.06         | a)   |
| CH0409938120               | 0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23<br>EMTN   | 1'100                              | 0                    | 1'100                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0419041246               | 0.1250 % PBBGR 0 1/8 06/05/23 EMTN      | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0465347661               | 1.6250 % DB 1 5/8 09/12/22 EMTN         | 750                                | 0                    | 750                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0521333655               | 0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN         | 1'200                              | 0                    | 1'200                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0561923852               | 0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN        | 1'700                              | 0                    | 1'700                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH1134691620               | 0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN         | 3'200                              | 1'000                | 2'600                   | 1'600 CHF                                       | 91.60%     | 1'465'600.00          | 0.15         | a)   |
| CH1135555592               | 0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN        | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 88.70%     | 887'000.00            | 0.09         | a)   |
| CH1228838129               | 2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42<br>EMTN  | 0                                  | 4'250                | 0                       | 4'250 CHF                                       | 108.25%    | 4'600'625.00          | 0.46         | a)   |
| CH1271360609               | 1.6275 % NRWBK 1.6275 07/27/28<br>EMTN  | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.35%    | 2'508'750.00          | 0.25         | a)   |
| CH1277080508               | 1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35<br>EMTN  | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.93%    | 2'018'560.00          | 0.20         | a)   |
| CH1279261130               | 4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33         | 0                                  | 2'400                | 0                       | 2'400 CHF                                       | 102.20%    | 2'452'800.00          | 0.24         | a)   |
| CH1293238007               | 2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN      | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.08%    | 2'001'640.00          | 0.20         | a)   |
| <b>DE</b>                  |   |                                    |                      |                         |   |            | <b>18'727'695.00</b>  | <b>1.85</b>  |      |
| CH0474977912               | 0.6250 % DANBNK 0 5/8 11/24/22<br>EMTN  | 1'400                              | 0                    | 1'400                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| <b>DK</b>                  |   |                                    |                      |                         |   |            | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>  |      |
| CH0031408112               | 3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN        | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0367206684               | 0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN     | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH1104885954               | 0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26<br>EMTN  | 6'500                              | 2'000                | 2'500                   | 6'000 CHF                                       | 96.45%     | 5'787'000.00          | 0.57         | a)   |
| CH1112011577               | 0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN      | 1'000                              | 1'300                | 500                     | 1'800 CHF                                       | 90.50%     | 1'629'000.00          | 0.16         | a)   |
| CH1227937724               | 2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26<br>EMTN | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.00%    | 2'000'000.00          | 0.20         | a)   |
| CH1228837899               | 2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25<br>GMTN | 0                                  | 2'000                | 500                     | 1'500 CHF                                       | 100.40%    | 1'506'000.00          | 0.15         | a)   |
| CH1276269755               | 2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25<br>EMTN | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.85%    | 1'512'750.00          | 0.15         | a)   |
| <b>ES</b>                  |   |                                    |                      |                         |   |            | <b>12'434'750.00</b>  | <b>1.23</b>  |      |
| CH0545766534               | 0.1250 % NDASS 0 1/8 06/02/26 EMTN      | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH1264823514               | 2.4900 % NDASS 2.49 05/26/28 EMTN       | 0                                  | 1'400                | 0                       | 1'400 CHF                                       | 100.75%    | 1'410'500.00          | 0.14         | a)   |
| <b>FI</b>                  |   |                                    |                      |                         |   |            | <b>1'410'500.00</b>   | <b>0.14</b>  |      |
| CH0025826949               | 3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN     | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 111.95%    | 1'119'500.00          | 0.11         | a)   |
| CH0282344339               | 1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN        | 5'000                              | 0                    | 2'500                   | 2'500 CHF                                       | 99.00%     | 2'475'000.00          | 0.24         | a)   |
| CH0305398247               | 0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN      | 2'000                              | 0                    | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0341725858               | 0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN          | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0370634666               | 0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN      | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0416239777               | 0.5500 % RENAUL 0.55 05/30/23 EMTN      | 0                                  | 1'000                | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH0591979643               | 0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN         | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 92.10%     | 1'842'000.00          | 0.18         | a)   |
| CH1115424702               | 0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN       | 4'000                              | 1'000                | 0                       | 5'000 CHF                                       | 88.95%     | 4'447'500.00          | 0.44         | a)   |
| CH1125186663               | 0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN       | 0                                  | 1'400                | 1'400                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                  | 0.00         |      |
| CH1142512347               | 0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN       | 3'800                              | 1'200                | 0                       | 5'000 CHF                                       | 91.90%     | 4'595'000.00          | 0.45         | a)   |
| CH1142754303               | 0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN        | 4'500                              | 2'000                | 1'500                   | 5'000 CHF                                       | 91.10%     | 4'555'000.00          | 0.45         | a)   |
| CH1231312690               | 2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN       | 0                                  | 2'350                | 1'000                   | 1'350 CHF                                       | 100.00%    | 1'350'000.00          | 0.13         | a)   |
| CH1248666955               | 2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30<br>EMTN | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 101.40%    | 2'535'000.00          | 0.25         | a)   |
| CH1251030107               | 1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN        | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.40%    | 2'510'000.00          | 0.25         | a)   |
| CH1256367207               | 2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27<br>EMTN  | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.95%    | 2'019'000.00          | 0.20         | a)   |
| CH1264414330               | 3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN     | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 103.20%    | 1'032'000.00          | 0.10         | a)   |
| CH1268922189               | 1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN      | 0                                  | 4'100                | 0                       | 4'100 CHF                                       | 100.00%    | 4'100'000.00          | 0.41         | a)   |
| CH1270825511               | 2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30<br>EMTN  | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 101.75%    | 2'035'000.00          | 0.20         | a)   |
| CH1276269730               | 2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN        | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 102.60%    | 2'052'000.00          | 0.20         | a)   |

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                          | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF      | in %<br>7)  | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|----------------------|-------------|------|
| CH1277028440               | 1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN    | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 102.05%    | 2'041'000.00         | 0.20        | a)   |
| CH1277240946               | 2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN  | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 102.95%    | 2'059'000.00         | 0.20        | a)   |
| CH1277582008               | 2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN   | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 101.00%    | 1'515'000.00         | 0.15        | a)   |
| CH1279261148               | 1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN    | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.25%    | 2'005'000.00         | 0.20        | a)   |
| CH1291809908               | 2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN       | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 100.21%    | 1'503'150.00         | 0.15        | a)   |
| <b>FR</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>45'790'150.00</b> | <b>4.53</b> |      |
| CH0426621683               | 1.1250 % BACR 1 1/8 07/12/23 EMTN    | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1115424686               | 0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN    | 3'000                              | 400                  | 2'200                   | 1'200 CHF                                       | 92.55%     | 1'110'600.00         | 0.11        | a)   |
| CH1145096157               | 0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN   | 3'000                              | 1'000                | 200                     | 3'800 CHF                                       | 86.65%     | 3'292'700.00         | 0.33        | a)   |
| CH1160382904               | 0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25          | 2'500                              | 500                  | 0                       | 3'000 CHF                                       | 97.40%     | 2'922'000.00         | 0.29        | a)   |
| CH1204175124               | 1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN   | 3'200                              | 0                    | 0                       | 3'200 CHF                                       | 96.95%     | 3'102'400.00         | 0.31        | a)   |
| CH1231312708               | 2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN    | 0                                  | 1'600                | 0                       | 1'600 CHF                                       | 100.70%    | 1'611'200.00         | 0.16        | a)   |
| CH1236363417               | 2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30       | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.75%    | 2'518'750.00         | 0.25        | a)   |
| CH1270825545               | 2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN    | 0                                  | 1'200                | 0                       | 1'200 CHF                                       | 101.05%    | 1'212'600.00         | 0.12        | a)   |
| CH1280994281               | 1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN   | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.10%    | 2'502'499.75         | 0.25        | a)   |
| CH1280994299               | 2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN    | 0                                  | 1'600                | 0                       | 1'600 CHF                                       | 100.24%    | 1'603'840.00         | 0.16        | a)   |
| CH1292012775               | 2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN    | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.17%    | 2'003'460.00         | 0.20        | a)   |
| <b>GB</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>21'880'049.75</b> | <b>2.17</b> |      |
| CH0379268748               | 2.1000 % RURAIL 2.1 10/02/23         | 2'000                              | 0                    | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0419041618               | 0.8980 % RURAIL 0.898 10/03/25       | 1'000                              | 0                    | 1'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| <b>IE</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b> |      |
| CH0467182413               | 0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN   | 2'000                              | 0                    | 0                       | 2'000 CHF                                       | 94.70%     | 1'894'000.00         | 0.19        | a)   |
| <b>JE</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>1'894'000.00</b>  | <b>0.19</b> |      |
| CH0418609621               | 0.6950 % HYUCAP 0.695 06/27/23 EMTN  | 1'250                              | 0                    | 1'250                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0419040917               | 0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN | 300                                | 0                    | 300                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0517825318               | 0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN   | 0                                  | 700                  | 0                       | 700 CHF   | 97.03%     | 679'210.00           | 0.07        | a)   |
| CH0551990713               | 0.7525 % HYUCAP 0.7525 07/06/23 GMTN | 2'000                              | 1'500                | 3'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1216400056               | 2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25         | 0                                  | 3'250                | 0                       | 3'250 CHF                                       | 100.10%    | 3'253'250.00         | 0.32        | a)   |
| CH1261608934               | 2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN | 0                                  | 1'250                | 0                       | 1'250 CHF                                       | 100.70%    | 1'258'750.00         | 0.12        | a)   |
| CH1271360633               | 2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN | 0                                  | 1'600                | 0                       | 1'600 CHF                                       | 100.04%    | 1'600'640.00         | 0.16        | a)   |
| <b>KR</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>6'791'850.00</b>  | <b>0.67</b> |      |
| CH1160112814               | 0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN  | 5'500                              | 900                  | 0                       | 6'400 CHF                                       | 99.27%     | 6'353'280.00         | 0.63        | a)   |
| <b>KY</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>6'353'280.00</b>  | <b>0.63</b> |      |
| CH0305557644               | 0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23          | 1'250                              | 0                    | 1'250                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0398677689               | 0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN  | 5'650                              | 300                  | 4'450                   | 1'500 CHF                                       | 92.70%     | 1'390'500.00         | 0.14        | a)   |
| <b>LU</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>1'390'500.00</b>  | <b>0.14</b> |      |
| CH0026620846               | 3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26       | 200                                | 0                    | 200                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0361533117               | 0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN  | 500                                | 0                    | 0                       | 500 CHF   | 87.55%     | 437'750.00           | 0.04        | a)   |
| CH0441004402               | 0.5000 % ACHMEA 0 1/2 11/15/22 EMTN  | 750                                | 0                    | 750                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1121837244               | 0.5500 % DLR 0.55 04/16/29           | 1'600                              | 400                  | 0                       | 2'000 CHF                                       | 87.10%     | 1'742'000.00         | 0.17        | a)   |
| CH1206367604               | 2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26          | 0                                  | 2'000                | 2'000                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1236363425               | 2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN | 0                                  | 2'000                | 1'200                   | 800 CHF   | 100.35%    | 802'800.00           | 0.08        | a)   |
| CH1256367181               | 1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN    | 0                                  | 1'850                | 0                       | 1'850 CHF                                       | 101.15%    | 1'871'275.00         | 0.19        | a)   |
| CH1264414348               | 2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN   | 0                                  | 1'830                | 0                       | 1'830 CHF                                       | 100.80%    | 1'844'640.00         | 0.18        | a)   |
| CH1273475421               | 2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN    | 0                                  | 1'000                | 0                       | 1'000 CHF                                       | 100.25%    | 1'002'500.00         | 0.10        | a)   |
| <b>NL</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>7'700'965.00</b>  | <b>0.76</b> |      |
| CH1184694730               | 1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN  | 3'000                              | 600                  | 0                       | 3'600 CHF                                       | 96.50%     | 3'474'000.00         | 0.34        | a)   |
| CH1230759537               | 1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN     | 0                                  | 800                  | 0                       | 800 CHF   | 98.60%     | 788'800.00           | 0.08        | a)   |
| CH1249416012               | 2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN    | 0                                  | 1'600                | 0                       | 1'600 CHF                                       | 100.15%    | 1'602'400.00         | 0.16        | a)   |
| CH1271360583               | 1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN      | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 101.35%    | 2'027'000.00         | 0.20        | a)   |
| CH1273429691               | 2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN   | 0                                  | 1'400                | 0                       | 1'400 CHF                                       | 100.65%    | 1'409'100.00         | 0.14        | a)   |
| <b>NO</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>9'301'300.00</b>  | <b>0.92</b> |      |
| CH0350030414               | 0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN    | 800                                | 0                    | 800                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1148308740               | 0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN  | 6'000                              | 2'000                | 500                     | 7'500 CHF                                       | 88.80%     | 6'660'000.00         | 0.66        | a)   |
| <b>NZ</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>6'660'000.00</b>  | <b>0.66</b> |      |

| ISIN /<br>Fälligkeitsdatum | Bezeichnung                          | Anz / Nom<br>in Tsd.<br>01.09.2022 | Kauf<br>Zugang<br>2) | Verkauf<br>Abgang<br>3) | Anz / Nom<br>in Tsd. Wäh-<br>rung<br>31.08.2023 | Kurs<br>8) | Kurswert<br>CHF      | in %<br>7)  | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|----------------------|-------------|------|
| CH0373945085               | 0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN    | 1'500                              | 0                    | 0                       | 1'500 CHF                                       | 92.00%     | 1'380'000.00         | 0.14        | a)   |
| CH0406415304               | 0.2000 % LANSBK 0.2 04/17/26 EMTN    | 1'000                              | 0                    | 0                       | 1'000 CHF                                       | 95.65%     | 956'500.00           | 0.09        | a)   |
| CH1184694714               | 1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN  | 3'000                              | 600                  | 3'600                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1271360401               | 2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN  | 0                                  | 1'600                | 0                       | 1'600 CHF                                       | 100.80%    | 1'612'800.00         | 0.16        | a)   |
| CH1271360419               | 1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 101.15%    | 2'528'750.00         | 0.25        | a)   |
| <b>SE</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>6'478'050.00</b>  | <b>0.64</b> |      |
| CH1228837881               | 1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25        | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 99.30%     | 1'489'500.00         | 0.15        | a)   |
| <b>SG</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>1'489'500.00</b>  | <b>0.15</b> |      |
| CH0260769424               | 1.3750 % T 1 3/8 12/04/24            | 5'100                              | 1'000                | 6'100                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0299477353               | 0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN     | 7'800                              | 0                    | 7'800                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0365501474               | 0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN       | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0373945044               | 0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN     | 3'670                              | 0                    | 1'670                   | 2'000 CHF                                       | 96.05%     | 1'921'000.00         | 0.19        | a)   |
| CH0471297959               | 0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN  | 1'500                              | 0                    | 1'500                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0474977722               | 0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN    | 500                                | 0                    | 500                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0564642095               | 0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN  | 2'370                              | 0                    | 2'370                   | 0 CHF   | 88.60%     | 2'099'820.00         | 0.21        | a)   |
| CH0572327028               | 0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN      | 200                                | 500                  | 700                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH0581947790               | 0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN     | 800                                | 0                    | 800                     | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1100259782               | 0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN      | 3'000                              | 1'100                | 0                       | 4'100 CHF                                       | 88.00%     | 3'608'000.00         | 0.36        | a)   |
| CH1105672666               | 0.5550 % VZ 0.555 03/24/31           | 900                                | 500                  | 1'400                   | 0 CHF   | 0.00%      | 0.00                 | 0.00        |      |
| CH1105672682               | 0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN  | 3'500                              | 1'000                | 2'000                   | 2'500 CHF                                       | 86.65%     | 2'166'250.00         | 0.21        | a)   |
| CH1112011536               | 0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN        | 4'900                              | 2'000                | 2'900                   | 4'000 CHF                                       | 91.55%     | 3'662'000.00         | 0.36        | a)   |
| CH1129053802               | 0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN       | 4'000                              | 2'000                | 0                       | 6'000 CHF                                       | 88.35%     | 5'301'000.00         | 0.52        | a)   |
| CH1142754329               | 0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN    | 6'500                              | 2'000                | 500                     | 8'000 CHF                                       | 88.70%     | 7'096'000.00         | 0.70        | a)   |
| CH1199659934               | 2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN      | 5'310                              | 900                  | 0                       | 6'210 CHF                                       | 99.80%     | 6'197'580.00         | 0.61        | a)   |
| CH1255924461               | 2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN   | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 101.75%    | 1'526'250.00         | 0.15        | a)   |
| CH1271360625               | 2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28         | 0                                  | 1'400                | 0                       | 1'400 CHF                                       | 100.71%    | 1'409'995.86         | 0.14        | a)   |
| <b>US</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>34'987'895.86</b> | <b>3.46</b> |      |
| CH1135555576               | 0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN    | 6'000                              | 1'000                | 1'000                   | 6'000 CHF                                       | 84.65%     | 5'079'000.00         | 0.50        | a)   |
| CH1151526238               | 0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN      | 4'000                              | 2'000                | 0                       | 6'000 CHF                                       | 93.80%     | 5'628'000.00         | 0.56        | a)   |
| CH1191066278               | 1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN  | 4'250                              | 500                  | 0                       | 4'750 CHF                                       | 98.20%     | 4'664'500.00         | 0.46        | a)   |
| CH1243933590               | 2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN    | 0                                  | 2'000                | 0                       | 2'000 CHF                                       | 100.35%    | 2'007'000.00         | 0.20        | a)   |
| CH1271360567               | 1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN     | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 100.80%    | 2'520'000.00         | 0.25        | a)   |
| CH1271360575               | 1.7500 % AIB 1 3/4 06/26/30          | 0                                  | 2'500                | 0                       | 2'500 CHF                                       | 101.05%    | 2'526'250.00         | 0.25        | a)   |
| CH1282304489               | 1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN   | 0                                  | 1'500                | 0                       | 1'500 CHF                                       | 101.20%    | 1'518'000.00         | 0.15        | a)   |
| <b>XS</b>                  |                                      |                                    |                      |                         |   |            | <b>23'942'750.00</b> | <b>2.37</b> |      |

## Vermögensaufstellung

|   | Kurswert<br>CHF         | in %<br>7)    |
|---|-------------------------|---------------|
| Bankguthaben auf Sicht  | 2'183'602.04            | 0.22          |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 1'001'568'440.61        | 99.12         |
| Sonstige Vermögenswerte   | 6'679'568.00            | 0.66          |
| <b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>                         | <b>1'010'431'610.65</b> | <b>100.00</b> |
| Andere Verbindlichkeiten  | -36'593.92              |               |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>                          | <b>1'010'395'016.73</b> |               |

## Bewertungskategorien

|  | Kurswert<br>CHF  | in %<br>7) |
|--|------------------|------------|
| a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG); | 1'001'568'440.61 | 99.12      |
| b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;  | 0.00             | 0.00       |
| c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.                              | 0.00             | 0.00       |

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2022 - 31.08.2023

| Klasse | Währung | Ausgabespesen,<br>Ausgabekomm.<br>in % zu Gunsten 30) |              | Rücknahmespesen,<br>Rücknahmekomm.<br>in % zu Gunsten 30) |              |
|--------|---------|---|--------------|---|--------------|
|        |         | Teilvermögen  | Fondsleitung | Teilvermögen  | Fondsleitung |
| A      | CHF     | 0.30  | -            | 0.30  | -            |
| B      | CHF     | 0.30  | -            | 0.30  | -            |
| It     | CHF     | 0.30  | -            | 0.30  | -            |
| Nt     | CHF     | 0.30  | -            | 0.30  | -            |

## 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 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.09.2022 - 31.08.2023

| Klasse | VK p.a. in % |       | VK Zielfonds     |
|--------|--------------|-------|------------------|
|        | Eff          | Max   | p.a. in %<br>Max |
| A      | 0.600        | 1.000 | -                |
| B      | 0.600        | 1.000 | -                |
| It     | 0.190        | 0.400 | -                |
| Nt     | 0.030        | 0.200 | -                |

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der 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

Swiss Bond Index (SBI) ® AAA-BBB TR

## 9 TER

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

## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 05.12.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 08.12.2023

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| A      | Nein            | CHF     | 0.35000          | 0.12250              | 0.22750         |

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 05.12.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 08.12.2023

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| B      | Nein            | CHF     | 0.36221          | 0.12677              | 0.23544         |
| It     | Nein            | CHF     | 0.76000          | 0.26600              | 0.49400         |
| Nt     | Nein            | CHF     | 0.91766          | 0.32118              | 0.59648         |

## 12 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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)

## 13 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 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 Konstanthaltung 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.

Er wird auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Der Besondere Teil kann für einzelne Rechnungseinheiten bzw. Referenzwährungen abweichende Rundungsbestimmungen vorsehen.

7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse

bestimmt.

Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
- b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen 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 Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.



## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### BEKB Obligationenfonds

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

BEKB Obligationen CHF

BEKB Obligationen Global Staatsanleihen

BEKB Obligationen Global Unternehmensanleihen

BEKB Obligationen Nachhaltig CHF

BEKB Obligationen Nachhaltig Global

BEKB Obligationen CHF Short Duration

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, die Anlagepolitik im Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Die Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 3 Bst. ba des Fondsvertrages präzisiert werden.

In der erwähnten Bestimmung wird bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

Somit ist in § 8 Ziff. 3 Bst. ba neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Schuldverschreibungen, Pfandbriefe, ausgenommen sind Asset Backed Securities ABS) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören.

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderung des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 7. Juni 2023

### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich