



# BEKB OBLIGATIONEN CHF

Halbjahresbericht per 29.02.2024

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, 26.04.2024

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	15
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	15
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
7	Verwaltungskommission	16
8	Benchmark	16
9	TER	16
10	Fussnoten	17
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident  
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,  
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident  
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,  
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied  
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

## Geschäftsleitung

Hans Frey  
Geschäftsführer  
Andreas Hogg  
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services  
Silvia Karrer  
Leiterin Administration & Operations

## Delegationen

Anlageentscheide 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	01.09.2023	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020
	bis	29.02.2024	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'005'159'447.37	1'010'395'016.73	894'537'480.25	759'924'468.36
<b>Klasse A</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'838'321.19	10'027'748.51	10'802'931.16	13'399'147.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		110'797.810	115'533.694	126'451.901	138'385.671
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		88.80	86.80	85.43	96.82
Ausschüttung je Anteil		-	0.35	0.20	0.30
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		1'987'356.50	1'996'055.89	2'748'448.45	3'194'973.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		21'756.587	22'412.587	31'403.357	32'295.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		91.35	89.06	87.52	98.93
Thesaurierung je Anteil		-	0.36	0.18	0.37
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		74'502'797.86	38'082'321.15	40'920'341.70	38'008'442.80
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		770'116.879	404'021.292	442'950.292	364'915.644
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.74	94.26	92.38	104.16
Thesaurierung je Anteil		-	0.76	0.57	0.82
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		918'830'971.82	960'288'891.18	840'065'758.94	705'321'904.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'381'467.995	10'065'807.340	8'992'948.544	6'704'304.667
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		97.94	95.40	93.41	105.20
Thesaurierung je Anteil		-	0.91	0.75	0.99
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

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	2.71 %	7.59 %	-12.38 %	-2.31 %
Klasse B	2.71 %	7.58 %	-12.37 %	-2.31 %
Klasse It	2.91 %	8.01 %	-12.01 %	-1.91 %
Klasse Nt	3.00 %	8.20 %	-11.87 %	-1.76 %
Benchmark	2.55 %	7.36 %	-12.10 %	1.82 %
Tracking Error 33)	-	-	0.61 %	0.17 %

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	0.16 %
Klasse B	0.16 %
Klasse It	0.36 %
Klasse Nt	0.45 %

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)	29.02.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	3'296'622.20	2'183'602.04
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	992'525'107.00	1'001'568'440.61
Sonstige Vermögenswerte	9'376'100.32	6'679'568.00
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'005'197'829.52</b>	<b>1'010'431'610.65</b>
Andere Verbindlichkeiten	-38'382.15	-36'593.92
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'005'159'447.37</b>	<b>1'010'395'016.73</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Klasse A</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		115'533.694	126'451.901
Ausgegebene Anteile		1'150.000	1'995.000
Zurückgenommene Anteile		-5'885.884	-12'913.207
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>110'797.810</b>	<b>115'533.694</b>
<b>Klasse B</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'412.587	31'403.357
Ausgegebene Anteile		556.000	225.362
Zurückgenommene Anteile		-1'212.000	-9'216.132
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>21'756.587</b>	<b>22'412.587</b>
<b>Klasse It</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		404'021.292	442'950.292
Ausgegebene Anteile		385'174.365	4'740.000
Zurückgenommene Anteile		-19'078.778	-43'669.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>770'116.879</b>	<b>404'021.292</b>
<b>Klasse Nt</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'065'807.340	8'992'948.544
Ausgegebene Anteile		277'437.351	1'010'116.766
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	1'967'726.680
Zurückgenommene Anteile		-961'776.696	-1'751'723.324
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-153'261.326
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>9'381'467.995</b>	<b>10'065'807.340</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'010'395'016.73	894'537'480.25
Ausbezahlte Ausschüttung		-38'724.98	-24'038.06
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'326'639.95	-2'934'129.29
Saldo aus dem Anteilverkehr		-31'725'475.04	89'950'860.86
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		29'855'270.61	28'864'842.97
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'005'159'447.37</b>	<b>1'010'395'016.73</b>

## Erfolgsrechnung

	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Konsolidiert</b>			
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		43'578.00	8'101.60
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-1'378.70
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		6'203'810.31	10'110'045.67
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		186'811.17	715'704.53
<b>Total Ertrag</b>		<b>6'434'199.48</b>	<b>10'832'473.10</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-229'938.67	-431'466.13
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-287'912.84	-808'412.27
<b>Total Aufwand</b>		<b>-517'851.51</b>	<b>-1'239'878.40</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>5'916'347.97</b>	<b>9'592'594.40</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'982'972.44	-23'134'197.25
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		476'167.56	630'891.04
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>409'543.09</b>	<b>-12'910'711.51</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		29'445'727.52	41'775'736.38
<b>Gesamterfolg</b>		<b>29'855'270.61</b>	<b>28'865'024.87</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>992'525'107.00</b>	<b>98.74</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>992'525'107.00</b>	<b>98.74</b>	
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	103.05%	4'122'000.00	0.41	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.85%	1'527'750.00	0.15	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	101.05%	1'515'750.00	0.15	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.25%	2'025'000.00	0.20	a)
CH1271007952	2.3750 % HYN0E 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.15%	2'023'000.00	0.20	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	1'500	0	500	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.10	a)
<b>AT</b>							<b>12'234'000.00</b>	<b>1.22</b>	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.75%	1'975'000.00	0.20	a)
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	800	0	0	800 CHF	99.14%	793'120.00	0.08	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'750	0	1'750	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.09	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	5'000	0	0	5'000 CHF	101.40%	5'070'000.00	0.50	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	2'000	0	0	2'000 CHF	102.95%	2'059'000.00	0.20	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	102.75%	4'110'000.00	0.41	a)
<b>AU</b>							<b>14'948'120.00</b>	<b>1.49</b>	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	91.70%	1'650'600.00	0.16	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 CHF	101.80%	2'036'000.00	0.20	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	2'000	0	0	2'000 CHF	100.85%	2'017'000.00	0.20	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.25%	2'045'000.00	0.20	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	2'000	0	0	2'000 CHF	102.15%	2'043'000.00	0.20	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.45%	2'069'000.00	0.21	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	2'500	0	0	2'500 CHF	101.60%	2'540'000.00	0.25	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	101.20%	2'530'000.00	0.25	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.25%	1'533'750.00	0.15	a)
<b>CA</b>							<b>18'464'350.00</b>	<b>1.84</b>	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	3'500	0	0	3'500 CHF	171.70%	6'009'500.00	0.60	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	15'000	0	0	15'000 CHF	123.29%	18'493'500.00	1.84	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	8'100	1'900	0	10'000 CHF	119.47%	11'947'000.00	1.19	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	5'050	0	0	5'050 CHF	101.29%	5'115'145.00	0.51	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	15'000	0	0	15'000 CHF	103.42%	15'513'000.00	1.54	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	17'500	0	2'500	15'000 CHF	110.15%	16'522'500.00	1.64	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	14'500	0	1'500	13'000 CHF	105.49%	13'713'700.00	1.36	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	2'250	0	0	2'250 CHF	100.05%	2'251'125.00	0.22	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	5'400	0	0	5'400 CHF	101.50%	5'481'000.00	0.55	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLIL 2 7/8 03/27/42	2'060	0	0	2'060 CHF	109.90%	2'263'940.00	0.23	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	3'000	0	0	3'000 CHF	100.81%	3'024'300.00	0.30	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	8'500	0	0	8'500 CHF	100.20%	8'517'000.00	0.85	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLIL 3 09/27/52	400	0	0	400 CHF	111.80%	447'200.00	0.04	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	2'100	0	0	2'100 CHF	100.15%	2'103'150.00	0.21	a)
CH0208271541	3.0000 % KWLIL 3 04/02/48	1'430	0	0	1'430 CHF	111.75%	1'598'025.00	0.16	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'850	0	0	1'850 CHF	107.25%	1'984'125.00	0.20	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	3'950	0	950	3'000 CHF	148.54%	4'456'200.00	0.44	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	17'500	0	0	17'500 CHF	98.17%	17'179'750.00	1.71	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	5'850	0	850	5'000 CHF	93.55%	4'677'500.00	0.47	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	6'000	0	0	6'000 CHF	95.64%	5'738'400.00	0.57	a)
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	3'000	0	0	3'000 CHF	100.04%	3'001'200.00	0.30	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.94%	999'400.00	0.10	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	3'300	0	0	3'300 CHF	100.73%	3'324'090.00	0.33	a)
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	7'000	0	0	7'000 CHF	100.25%	7'017'500.00	0.70	a)
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	0	2'000	0	2'000 CHF	100.01%	2'000'200.00	0.20	a)
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	0	1'000	0	1'000 CHF	99.67%	996'700.00	0.10	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	3'700	0	0	3'700 CHF	96.15%	3'557'550.00	0.35	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	3'000	0	0	3'000 CHF	96.66%	2'899'800.00	0.29	a)
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	8'500	0	2'000	6'500 CHF	92.47%	6'010'550.00	0.60	a)
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	5'000	0	0	5'000 CHF	94.90%	4'745'000.00	0.47	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	10'000	0	0	10'000 CHF	98.15%	9'815'000.00	0.98	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	4'000	0	0	4'000 CHF	98.37%	3'934'800.00	0.39	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	10'000	0	2'000	8'000 CHF	94.84%	7'587'200.00	0.75	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	5'030	0	2'530	2'500 CHF	96.25%	2'406'250.00	0.24	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	2'000	0	500	1'500 CHF	98.77%	1'481'550.00	0.15	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	3'000	0	0	3'000 CHF	97.10%	2'913'000.00	0.29	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	0	2'000	0	2'000 CHF	98.05%	1'961'000.00	0.20	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	4'000	0	0	4'000 CHF	99.97%	3'998'800.00	0.40	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	5'100	0	0	5'100 CHF	96.24%	4'908'240.00	0.49	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	1'250	750	0	2'000 CHF	93.25%	1'865'000.00	0.19	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	1'330	1'170	0	2'500 CHF	93.68%	2'342'000.00	0.23	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	5'000	0	0	5'000 CHF	90.16%	4'508'000.00	0.45	a)
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLIL 2 12/11/23	2'700	0	2'700	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	95.47%	3'341'450.00	0.33	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.72%	997'200.00	0.10	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	2'600	0	0	2'600 CHF	92.00%	2'392'000.00	0.24	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	2'000	0	0	2'000 CHF	92.25%	1'845'000.00	0.18	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	5'500	0	2'500	3'000 CHF	96.20%	2'886'000.00	0.29	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391648018	1.5000 % NANTDR 1.55 08/19/25	5'000	0	0	5'000 CHF	99.90%	4'995'000.00	0.50	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	5'000	0	0	5'000 CHF	96.61%	4'830'500.00	0.48	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	2'050	0	0	2'050 CHF	97.00%	1'988'500.00	0.20	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	3'700	0	1'200	2'500 CHF	96.10%	2'402'500.00	0.24	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	10'000	0	0	10'000 CHF	94.65%	9'465'000.00	0.94	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.30%	1'926'000.00	0.19	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	7'000	0	2'000	5'000 CHF	97.45%	4'872'500.00	0.48	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	12'500	0	0	12'500 CHF	93.55%	11'693'750.00	1.16	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'300	0	0	2'300 CHF	91.15%	2'096'450.00	0.21	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	4'550	0	0	4'550 CHF	95.00%	4'322'500.00	0.43	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	3'000	0	0	3'000 CHF	92.20%	2'766'000.00	0.28	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	4'000	0	1'000	3'000 CHF	77.90%	2'337'000.00	0.23	a)
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	2'000	0	0	2'000 CHF	96.06%	1'921'200.00	0.19	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	0	2'000	0	2'000 CHF	94.27%	1'885'400.00	0.19	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	1'500	0	0	1'500 CHF	99.65%	1'494'750.00	0.15	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	0	2'000	0	2'000 CHF	94.03%	1'880'600.00	0.19	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	500	2'500	0	3'000 CHF	88.00%	2'640'000.00	0.26	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	0	2'000	0	2'000 CHF	109.40%	2'188'000.00	0.22	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	3'000	0	0	3'000 CHF	90.60%	2'718'000.00	0.27	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	4'500	0	0	4'500 CHF	90.60%	4'077'000.00	0.41	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	6'000	0	4'000	2'000 CHF	95.05%	1'901'000.00	0.19	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	2'000	0	0	2'000 CHF	93.59%	1'871'800.00	0.19	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'500	0	0	1'500 CHF	99.67%	1'495'050.00	0.15	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	3'500	0	0	3'500 CHF	88.90%	3'111'500.00	0.31	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	6'500	0	0	6'500 CHF	91.60%	5'954'000.00	0.59	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	3'600	0	500	3'100 CHF	91.75%	2'844'250.00	0.28	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	2'500	0	500	2'000 CHF	89.80%	1'796'000.00	0.18	a)
CH0506071379	0.2500 % AMALEA 0 1/4 10/27/23	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	8'950	0	0	8'950 CHF	96.85%	8'668'075.00	0.86	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	97.59%	1'463'850.00	0.15	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	8'200	0	1'200	7'000 CHF	86.45%	6'051'500.00	0.60	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	1'000	0	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.10	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	6'150	0	1'150	5'000 CHF	94.84%	4'742'000.00	0.47	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	9'000	0	0	9'000 CHF	92.31%	8'307'900.00	0.83	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	3'700	0	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'500	0	0	2'500 CHF	86.95%	2'173'750.00	0.22	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	1'500	0	0	1'500 CHF	95.98%	1'439'700.00	0.14	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	8'500	0	1'500	7'000 CHF	94.20%	6'594'000.00	0.66	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	6'500	0	0	6'500 CHF	98.90%	6'428'500.00	0.64	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	900	0	0	900 CHF	94.18%	847'620.00	0.08	a)
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	2'000	0	2'000 CHF	108.04%	2'160'800.00	0.21	a)
CH0557778872	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 OCT	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778906	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 NOV	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778914	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778922	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 JAN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778930	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 JAN	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778955	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45 FEB	0	1'170	1'170	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'000	0	0	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	0.10	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	3'000	0	0	3'000 CHF	93.60%	2'808'000.00	0.28	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	3'000	0	1'500	1'500 CHF	96.30%	1'444'500.00	0.14	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'250	0	0	2'250 CHF	93.75%	2'109'375.00	0.21	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	3'500	0	0	3'500 CHF	98.40%	3'444'000.00	0.34	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	2'400	0	0	2'400 CHF	86.60%	2'078'400.00	0.21	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	2'900	0	0	2'900 CHF	90.85%	2'634'650.00	0.26	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	3'550	0	0	3'550 CHF	94.05%	3'338'775.00	0.33	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	12'000	0	5'000	7'000 CHF	94.82%	6'637'400.00	0.66	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	2'500	0	0	2'500 CHF	91.33%	2'283'250.00	0.23	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31	6'500	0	3'500	3'000 CHF	90.50%	2'715'000.00	0.27	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.00%	970'000.00	0.10	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	4'055	0	2'055	2'000 CHF	96.75%	1'935'000.00	0.19	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'700	0	0	1'700 CHF	91.55%	1'556'350.00	0.15	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	9'400	0	0	9'400 CHF	89.80%	8'441'200.00	0.84	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	88.70%	1'774'000.00	0.18	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	10'000	0	0	10'000 CHF	80.47%	8'047'000.00	0.80	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33	4'500	0	1'500	3'000 CHF	86.80%	2'604'000.00	0.26	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	5'500	0	0	5'500 CHF	86.20%	4'741'000.00	0.47	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'300	0	0	2'300 CHF	83.20%	1'913'600.00	0.19	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	3'200	0	0	3'200 CHF	83.60%	2'675'200.00	0.27	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	2'700	0	0	2'700 CHF	87.40%	2'359'800.00	0.23	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	4'000	0	0	4'000 CHF	91.45%	3'658'000.00	0.36	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	5'000	0	1'000	4'000 CHF	92.40%	3'696'000.00	0.37	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	2'000	0	0	2'000 CHF	97.65%	1'953'000.00	0.19	a)
CH1139995778	0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24	2'900	0	0	2'900 CHF	99.31%	2'879'990.00	0.29	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	4'250	0	0	4'250 CHF	98.30%	4'177'750.00	0.42	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	1'500	0	0	1'500 CHF	95.95%	1'439'250.00	0.14	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	2'300	0	0	2'300 CHF	73.25%	1'684'750.00	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	7'600	0	0	7'600 CHF	93.90%	7'136'400.00	0.71	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	5'500	0	0	5'500 CHF	90.50%	4'977'500.00	0.50	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	5'000	0	0	5'000 CHF	90.67%	4'533'500.00	0.45	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'000	0	0	2'000 CHF	87.18%	1'743'600.00	0.17	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	10'000	0	0	10'000 CHF	90.65%	9'065'400.00	0.90	a)
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	1'850	0	0	1'850 CHF	97.00%	1'794'500.00	0.18	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	1'700	0	0	1'700 CHF	95.85%	1'629'450.00	0.16	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	2'000	0	0	2'000 CHF	94.15%	1'883'000.00	0.19	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	2'150	0	0	2'150 CHF	79.45%	1'708'175.00	0.17	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	8'000	0	0	8'000 CHF	99.85%	7'988'000.00	0.79	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	20'300	0	0	20'300 CHF	99.55%	20'208'650.00	2.01	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	2'500	0	0	2'500 CHF	99.35%	2'483'750.00	0.25	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	3'500	0	0	3'500 CHF	100.82%	3'528'700.00	0.35	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	9'180	0	0	9'180 CHF	104.05%	9'551'790.00	0.95	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	2'000	0	0	2'000 CHF	101.85%	2'037'000.00	0.20	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	1'000	0	0	1'000 CHF	119.87%	1'198'700.00	0.12	a)
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	1'700	0	0	1'700 CHF	109.75%	1'865'750.00	0.19	a)
CH1204501642	0.0000 % SWNBK 0 12/27/23 30	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	4'000	0	0	4'000 CHF	104.70%	4'188'000.00	0.42	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	2'000	0	0	2'000 CHF	105.70%	2'114'000.00	0.21	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	5'000	0	0	5'000 CHF	107.35%	5'367'500.00	0.53	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'500	0	0	2'500 CHF	103.95%	2'598'750.00	0.26	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	3'000	0	1'500	1'500 CHF	104.75%	1'571'250.00	0.16	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	1'200	0	0	1'200 CHF	110.81%	1'329'720.00	0.13	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	2'000	0	0	2'000 CHF	101.85%	2'037'000.00	0.20	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	2'700	0	0	2'700 CHF	102.95%	2'779'650.00	0.28	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	10'000	0	0	10'000 CHF	105.20%	10'520'000.00	1.05	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.80%	3'054'000.00	0.30	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	1'500	2'500	0	1'500 CHF	105.60%	1'584'000.00	0.16	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	1'725	0	1'725	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	1'660	0	0	1'660 CHF	100.60%	1'669'960.00	0.17	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	2'500	0	0	2'500 CHF	103.05%	2'576'250.00	0.26	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	2'000	0	0	2'000 CHF	110.75%	2'215'000.00	0.22	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	1'000	0	0	1'000 CHF	120.95%	1'209'500.00	0.12	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	1'500	0	0	1'500 CHF	104.40%	1'566'000.00	0.16	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	2'450	0	450	2'000 CHF	104.96%	2'099'200.00	0.21	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	1'500	0	0	1'500 CHF	102.05%	1'530'750.00	0.15	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	3'000	0	0	3'000 CHF	103.75%	3'112'500.00	0.31	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	1'500	0	0	1'500 CHF	106.45%	1'596'750.00	0.16	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLLI 2 3/4 03/01/30	1'200	0	0	1'200 CHF	105.50%	1'266'000.00	0.13	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	1'870	0	0	1'870 CHF	101.30%	1'894'310.00	0.19	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	100.50%	3'015'000.00	0.30	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	1'500	0	0	1'500 CHF	103.70%	1'555'500.00	0.15	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	400	0	0	400 CHF	103.05%	412'200.00	0.04	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	2'500	0	0	2'500 CHF	102.30%	2'557'500.00	0.25	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	1'500	0	0	1'500 CHF	102.20%	1'533'000.00	0.15	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	2'000	0	0	2'000 CHF	106.35%	2'127'000.00	0.21	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	825	0	0	825 CHF	106.67%	880'027.50	0.09	a)
CH1255924446	3.0000 % REGEMM 3 04/16/27	1'000	0	0	1'000 CHF	101.85%	1'018'500.00	0.10	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	1'000	0	0	1'000 CHF	103.60%	1'036'000.00	0.10	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	1'100	0	0	1'100 CHF	104.90%	1'153'900.00	0.11	a)
CH1258960603	0.0000 % SWNBK 0 01/22/24 26	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887436	2.9500 % SPIMAE 2.95 07/13/26	1'250	0	0	1'250 CHF	101.80%	1'272'500.00	0.13	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	1'250	0	1'250 CHF	101.95%	1'274'375.00	0.13	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	1'000	0	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.10	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	1'000	0	0	1'000 CHF	108.75%	1'087'500.00	0.11	a)
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	1'250	0	0	1'250 CHF	108.75%	1'359'375.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1266847180	1.7000 % EGW 1.7 07/20/43 69	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	2'000	2'500	0	4'500 CHF	103.62%	4'662'900.00	0.46	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	1'500	0	0	1'500 CHF	101.00%	1'515'000.00	0.15	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	940	0	0	940 CHF	107.35%	1'009'090.00	0.10	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	0	1'000	0	1'000 CHF	101.84%	1'018'370.00	0.10	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	1'500	0	0	1'500 CHF	107.63%	1'614'450.00	0.16	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	3'000	0	0	3'000 CHF	109.98%	3'299'400.00	0.33	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	1'250	0	0	1'250 CHF	101.20%	1'265'000.00	0.13	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	2'000	0	0	2'000 CHF	104.30%	2'086'000.00	0.21	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	1'050	0	0	1'050 CHF	106.20%	1'115'100.00	0.11	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	2'000	0	0	2'000 CHF	105.75%	2'115'000.00	0.21	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	2'000	0	2'000 CHF	102.72%	2'054'400.00	0.20	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	1'000	0	1'000 CHF	106.51%	1'065'100.00	0.11	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	2'000	0	0	2'000 CHF	102.40%	2'048'000.00	0.20	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	1'500	0	0	1'500 CHF	102.95%	1'544'250.00	0.15	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	2'500	0	0	2'500 CHF	103.25%	2'581'250.00	0.26	a)
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	2'000	0	0	2'000 CHF	108.95%	2'179'000.00	0.22	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	1'500	0	0	1'500 CHF	102.10%	1'531'500.00	0.15	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	1'700	0	1'700 CHF	106.20%	1'805'400.00	0.18	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	820	0	820 CHF	89.20%	731'440.00	0.07	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	1'750	0	1'750 CHF	101.70%	1'779'750.00	0.18	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	0	1'500	0	1'500 CHF	103.65%	1'554'750.00	0.15	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	2'000	0	2'000 CHF	101.55%	2'031'000.00	0.20	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	2'000	0	2'000 CHF	104.50%	2'090'000.00	0.21	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	1'200	0	0	1'200 CHF	105.90%	1'270'800.00	0.13	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	1'580	0	1'580 CHF	104.75%	1'655'050.00	0.16	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	1'500	0	1'500 CHF	101.80%	1'527'000.00	0.15	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	0	2'000	0	2'000 CHF	104.85%	2'097'000.00	0.21	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	1'300	0	1'300 CHF	109.55%	1'424'150.00	0.14	a)
CH1296291037	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	2'500	0	2'500 CHF	103.60%	2'590'000.00	0.26	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	0	2'000	0	2'000 CHF	104.61%	2'092'200.00	0.21	a)
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	0	1'500	0	1'500 CHF	105.35%	1'580'250.00	0.16	a)
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	0	1'500	0	1'500 CHF	105.15%	1'577'250.00	0.16	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	1'000	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.10	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	815	0	815 CHF	105.00%	855'750.00	0.09	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	1'250	0	1'250 CHF	106.00%	1'325'000.00	0.13	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	1'500	0	1'500 CHF	101.95%	1'529'250.00	0.15	a)
CH1305916855	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117024	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 NOV	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	0	2'000	0	2'000 CHF	101.60%	2'032'000.00	0.20	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	2'500	0	2'500 CHF	99.95%	2'498'750.00	0.25	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	935	0	935 CHF	99.75%	932'662.50	0.09	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	500	0	500 CHF	101.20%	506'000.00	0.05	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLIU 2 3/8 12/05/29	0	1'160	0	1'160 CHF	103.25%	1'197'700.00	0.12	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	0	1'000	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	0.10	a)
CH1310346254	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 JAN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	1'150	0	1'150 CHF	102.70%	1'181'050.00	0.12	a)
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	0	1'500	0	1'500 CHF	101.20%	1'518'000.00	0.15	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	1'280	0	1'280 CHF	101.55%	1'299'840.00	0.13	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	660	0	660 CHF	102.00%	673'200.00	0.07	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	1'000	0	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	0.10	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	2'000	0	2'000 CHF	100.25%	2'005'000.00	0.20	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	0	1'500	0	1'500 CHF	101.00%	1'515'000.00	0.15	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	1'000	0	1'000 CHF	101.28%	1'012'800.00	0.10	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	690	0	690 CHF	102.70%	708'630.00	0.07	a)
<b>CH</b>							<b>713'948'540.00</b>	<b>71.03</b>	
CH1137122789	1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	94.80%	3'033'600.00	0.30	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	6'200	0	1'200	5'000 CHF	95.25%	4'762'500.00	0.47	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	102.30%	1'534'500.00	0.15	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	100.89%	1'513'350.00	0.15	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	2'500	0	2'500 CHF	102.60%	2'565'000.00	0.26	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.55%	1'508'250.00	0.15	a)
<b>CL</b>							<b>14'917'200.00</b>	<b>1.48</b>	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'180	0	2'180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	94.45%	1'511'200.00	0.15	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.35%	913'500.00	0.09	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	4'250	0	0	4'250 CHF	113.15%	4'808'875.00	0.48	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	101.85%	1'527'750.00	0.15	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	104.70%	2'094'000.00	0.21	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	2'400	0	0	2'400 CHF	104.60%	2'510'400.00	0.25	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.45%	2'029'000.00	0.20	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.70%	2'034'000.00	0.20	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.85%	1'527'750.00	0.15	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	1'770	0	1'770 CHF	104.25%	1'845'225.00	0.18	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	1'500	0	1'500 CHF	100.65%	1'509'750.00	0.15	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.00%	1'010'000.00	0.10	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	101.25%	2'531'250.00	0.25	a)
<b>DE</b>							<b>25'852'700.00</b>	<b>2.57</b>	
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	0	2'500	0	2'500 CHF	102.45%	2'561'250.00	0.25	a)
<b>DK</b>							<b>2'561'250.00</b>	<b>0.25</b>	
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	97.95%	5'877'000.00	0.58	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.05%	2'021'000.00	0.20	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.25%	1'518'750.00	0.15	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCEF 2.7325 07/04/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.32%	1'519'800.00	0.15	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.52%	2'030'320.00	0.20	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	1'250	0	1'250 CHF	102.02%	1'275'287.50	0.13	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	100.61%	1'408'596.00	0.14	a)
<b>ES</b>							<b>15'650'753.50</b>	<b>1.56</b>	
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.35%	1'432'900.00	0.14	a)
<b>FI</b>							<b>1'432'900.00</b>	<b>0.14</b>	
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	99.77%	1'496'550.00	0.15	a)
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.35%	993'500.00	0.10	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.30%	1'886'000.00	0.19	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	5'000	0	1'000	4'000 CHF	92.00%	3'680'000.00	0.37	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	94.55%	4'727'500.00	0.47	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	93.85%	4'692'500.00	0.47	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	1'350	0	0	1'350 CHF	101.50%	1'370'250.00	0.14	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	103.40%	2'585'000.00	0.26	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	101.65%	2'541'250.00	0.25	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.50%	2'050'000.00	0.20	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	105.55%	1'055'500.00	0.11	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	4'100	0	2'100	2'000 CHF	101.65%	2'033'000.00	0.20	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	104.10%	2'082'000.00	0.21	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	105.15%	2'103'000.00	0.21	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	104.85%	2'097'000.00	0.21	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	105.25%	2'105'000.00	0.21	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.90%	2'038'000.00	0.20	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.75%	2'035'000.00	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290871024	1.5125 % RATFPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	100.47%	1'406'580.00	0.14	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	102.50%	1'537'500.00	0.15	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.55%	1'538'250.00	0.15	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	103.85%	1'557'750.00	0.15	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.25%	2'005'000.00	0.20	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.25%	1'533'750.00	0.15	a)
<b>FR</b>							<b>51'149'880.00</b>	<b>5.09</b>	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	95.35%	1'144'200.00	0.11	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	3'800	0	0	3'800 CHF	89.90%	3'416'200.00	0.34	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	3'000	0	1'000	2'000 CHF	98.60%	1'972'000.00	0.20	a)
CH1204175124	1.9150 % NWISE 1.915 09/08/28 EMTN	3'200	0	700	2'500 CHF	100.10%	2'502'500.00	0.25	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	103.10%	1'649'600.00	0.16	a)
CH1236363417	2.0125 % NWISE 2.0125 01/23/30	2'500	0	0	2'500 CHF	102.70%	2'567'500.00	0.26	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	103.75%	1'245'000.00	0.12	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	101.30%	2'532'500.00	0.25	a)
CH1280994299	2.9700 % NWISE 2.97 09/08/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	102.35%	1'637'600.00	0.16	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.25%	2'025'000.00	0.20	a)
<b>GB</b>							<b>20'692'100.00</b>	<b>2.06</b>	
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.70%	1'934'000.00	0.19	a)
<b>JE</b>							<b>1'934'000.00</b>	<b>0.19</b>	
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	700	0	0	700 CHF	98.62%	690'340.00	0.07	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	3'250	0	0	3'250 CHF	100.75%	3'274'375.00	0.33	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	102.20%	1'277'500.00	0.13	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	100.75%	1'612'000.00	0.16	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.65%	1'509'750.00	0.15	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.20%	1'503'000.00	0.15	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	1'400	0	1'400 CHF	101.20%	1'416'800.00	0.14	a)
<b>KR</b>							<b>11'283'765.00</b>	<b>1.12</b>	
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	6'400	0	6'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>KY</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	1'000	0	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.10	a)
CH1323274055	2.0000 % LGT 2 02/15/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.00%	2'020'000.00	0.20	a)
<b>LI</b>							<b>3'040'500.00</b>	<b>0.30</b>	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	1'500	0	500	1'000 CHF	96.87%	968'700.00	0.10	a)
<b>LU</b>							<b>968'700.00</b>	<b>0.10</b>	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	2'000	0	0	2'000 CHF	91.40%	1'828'000.00	0.18	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	800	0	0	800 CHF	102.10%	816'800.00	0.08	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	102.05%	1'887'925.00	0.19	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	1'830	0	0	1'830 CHF	101.70%	1'861'110.00	0.19	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	101.60%	1'320'800.00	0.13	a)
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	103.10%	1'546'500.00	0.15	a)
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	102.90%	1'131'900.00	0.11	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.98%	1'514'745.00	0.15	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	0	2'050	0	2'050 CHF	102.60%	2'103'238.50	0.21	a)
<b>NL</b>							<b>14'011'018.50</b>	<b>1.39</b>	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	3'600	0	1'850	1'750 CHF	98.40%	1'722'000.00	0.17	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	102.20%	1'635'200.00	0.16	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.60%	2'052'000.00	0.20	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	101.50%	1'421'000.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.70%	2'034'000.00	0.20	a)
<b>NO</b>							<b>8'864'200.00</b>	<b>0.88</b>	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	7'500	0	3'500	4'000 CHF	92.15%	3'686'000.00	0.37	a)
<b>NZ</b>							<b>3'686'000.00</b>	<b>0.37</b>	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	102.65%	1'642'400.00	0.16	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	102.60%	2'565'000.00	0.26	a)
<b>SE</b>							<b>4'207'400.00</b>	<b>0.42</b>	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>SG</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.90%	1'958'000.00	0.19	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	2'370	0	870	1'500 CHF	92.00%	1'380'000.00	0.14	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	4'100	0	1'100	3'000 CHF	91.65%	2'749'500.00	0.27	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	2'500	0	500	2'000 CHF	90.70%	1'814'000.00	0.18	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	4'000	0	1'000	3'000 CHF	94.40%	2'832'000.00	0.28	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	91.85%	5'511'000.00	0.55	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	8'000	0	3'500	4'500 CHF	92.95%	4'182'750.00	0.42	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	6'210	0	2'210	4'000 CHF	101.40%	4'056'000.00	0.40	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	103.85%	1'557'750.00	0.15	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	1'400	0	0	1'400 CHF	103.65%	1'451'100.00	0.14	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	0	1'000	0	1'000 CHF	100.77%	1'007'740.00	0.10	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	2'000	0	2'000 CHF	101.28%	2'025'640.00	0.20	a)
<b>US</b>							<b>30'525'480.00</b>	<b>3.04</b>	
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	86.45%	5'187'000.00	0.52	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 CHF	95.95%	4'797'500.00	0.48	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	4'750	0	750	4'000 CHF	99.30%	3'972'000.00	0.40	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.95%	2'039'000.00	0.20	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	102.35%	2'558'750.00	0.25	a)
CH1271360575	1.7500 % AIIB 1 3/4 06/26/30	2'500	0	500	2'000 CHF	102.65%	2'053'000.00	0.20	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	103.00%	1'545'000.00	0.15	a)
<b>XS</b>							<b>22'152'250.00</b>	<b>2.20</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'296'622.20	0.33
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	992'525'107.00	98.74
Sonstige Vermögenswerte	9'376'100.32	0.93
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'005'197'829.52</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-38'382.15	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'005'159'447.37</b>	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	992'525'107.00	98.74
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

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

Periode: 01.09.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. 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:** 01.09.2023 - 29.02.2024

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % 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 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)

## 11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit 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 all-fällige 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.