



# BEKB OBLIGATIONEN NACHHALTIG 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	36597695	CHF
B	36597693	CHF
lt	36597689	CHF
Nt	36597692	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	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
12	Fussnoten	15
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
14	Pflichtpublikationen	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 (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		466'733'923.64	423'742'013.16	369'836'913.81	257'046'878.16
<b>Klasse A</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'249'307.67	359'541.17	463'347.20	231'903.46
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'072.470	4'105.000	4'680.000	2'332.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		88.78	87.59	99.01	99.44
Ausschüttung je Anteil		0.25	0.10	0.40	0.60
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
<b>Klasse B</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		937'181.38	741'571.22	611'499.76	287'082.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'416.802	8'359.851	6'115.851	2'871.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		89.97	88.71	99.99	99.99
Thesaurierung je Anteil		0.27	0.13	0.34	0.47
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
<b>Klasse It</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'322'682.95	23'192'797.38	26'485'343.02	23'882'940.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		229'735.000	254'095.000	258'119.659	233'360.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		92.81	91.28	102.61	102.34
Thesaurierung je Anteil		0.65	0.53	0.77	0.91
Total Expense Ratio (TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
<b>Klasse Nt</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		443'224'751.64	399'448'103.39	342'276'723.83	232'644'951.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'847'561.759	4'446'888.853	3'393'112.068	2'314'676.839
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		91.43	89.83	100.87	100.51
Thesaurierung je Anteil		0.78	0.67	0.91	1.05
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	1.47 %	-12.14 %	-2.38 %	0.44 %
Klasse B	1.47 %	-12.15 %	-2.37 %	0.45 %
Klasse It	1.88 %	-11.78 %	-1.98 %	0.87 %
Klasse Nt	2.05 %	-11.63 %	-1.82 %	1.01 %
Benchmark	1.77 %	-12.10 %	-1.82 %	0.90 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	0.53 %	0.61 %	0.14 %	1.01 %

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	-0.30 %
Klasse B	-0.30 %
Klasse It	0.11 %
Klasse Nt	0.28 %

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	1'414'724.82	3'201'698.78
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	462'598'024.78	418'535'742.50
Sonstige Vermögenswerte	2'736'883.46	2'020'117.29
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>466'749'633.06</b>	<b>423'757'558.57</b>
Andere Verbindlichkeiten	-15'709.42	-15'545.41
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>466'733'923.64</b>	<b>423'742'013.16</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'105.000	4'680.000
Ausgegebene Anteile		11'567.470	665.000
Zurückgenommene Anteile		-1'600.000	-1'240.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>14'072.470</b>	<b>4'105.000</b>

Klasse B	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'359.851	6'115.851
Ausgegebene Anteile		3'656.951	2'244.000
Zurückgenommene Anteile		-1'600.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>10'416.802</b>	<b>8'359.851</b>

Klasse It	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		254'095.000	258'119.659
Ausgegebene Anteile		3'800.000	3'445.000
Zurückgenommene Anteile		-28'160.000	-7'469.659
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>229'735.000</b>	<b>254'095.000</b>

Klasse Nt	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'446'888.853	3'393'112.068
Ausgegebene Anteile		1'284'882.716	1'394'239.079
Zurückgenommene Anteile		-884'209.810	-340'462.294
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>4'847'561.759</b>	<b>4'446'888.853</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		423'742'013.16	369'836'913.81
Ausbezahlte Ausschüttung		-410.50	-1'720.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'113'747.98	-1'233'934.88
Saldo aus dem Anteilverkehr		34'924'572.73	99'813'465.06
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		9'181'496.23	-44'672'710.83
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>466'733'923.64</b>	<b>423'742'013.16</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		8'104.15	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'356.80	-55'991.70
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'841'976.31	2'998'536.43
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		559'343.43	499'174.03
<b>Total Ertrag</b>		<b>4'408'067.09</b>	<b>3'441'718.76</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-61.80
Reglementarische Vergütungen		-171'107.32	-165'086.39
Sonstige Aufwendungen		0.00	-24.70
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-277'863.00	-138'258.67
<b>Total Aufwand</b>		<b>-448'970.32</b>	<b>-303'431.56</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>3'959'096.77</b>	<b>3'138'287.20</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-8'212'027.53	-6'352'481.00
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		471'947.71	249'035.24
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-3'780'983.05</b>	<b>-2'965'158.56</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		12'962'479.28	-41'707'552.27
<b>Gesamterfolg</b>		<b>9'181'496.23</b>	<b>-44'672'710.83</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	4'068.19	527.79
Vortrag des Vorjahres	125.38	8.09
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>4'193.57</b>	<b>535.88</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	3'518.12	410.50
Vortrag auf neue Rechnung	675.45	125.38
<b>Total</b>	<b>4'193.57</b>	<b>535.88</b>
<b>Klasse B</b>	<b>31.08.2023</b>	<b>31.08.2022</b>
Nettoertrag	2'822.92	1'089.62
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>2'822.92</b>	<b>1'089.62</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	988.02	381.37
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'834.90	708.25
<b>Total</b>	<b>2'822.92</b>	<b>1'089.62</b>
<b>Klasse It</b>	<b>31.08.2023</b>	<b>31.08.2022</b>
Nettoertrag	149'667.81	134'996.38
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>149'667.81</b>	<b>134'996.38</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	52'383.73	47'248.73
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	97'284.08	87'747.65
<b>Total</b>	<b>149'667.81</b>	<b>134'996.38</b>
<b>Klasse Nt</b>	<b>31.08.2023</b>	<b>31.08.2022</b>
Nettoertrag	3'802'537.85	3'001'673.41
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>3'802'537.85</b>	<b>3'001'673.41</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'330'888.25	1'050'585.69
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'471'649.60	1'951'087.72
<b>Total</b>	<b>3'802'537.85</b>	<b>3'001'673.41</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>462'598'024.78</b>	<b>99.11</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>462'598'024.78</b>	<b>99.11</b>	
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.95%	1'029'500.00	0.22	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	750	0	750 CHF	101.05%	757'875.00	0.16	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.35%	1'003'500.00	0.21	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.75%	2'015'000.00	0.43	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	750	0	750 CHF	100.45%	753'375.00	0.16	a)
<b>AT</b>							<b>5'559'250.00</b>	<b>1.19</b>	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.21	a)
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.25%	1'805'000.00	0.39	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	0	2'500	0	2'500 CHF	99.65%	2'491'250.00	0.53	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	1'000	0	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.22	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	100.70%	2'517'500.00	0.54	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.79%	997'900.00	0.21	a)
<b>AU</b>							<b>9'796'650.00</b>	<b>2.10</b>	
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	4'000	0	1'000	3'000 CHF	88.30%	2'649'000.00	0.57	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	0	1'250	0	1'250 CHF	100.35%	1'254'375.00	0.27	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	0	1'000	0	1'000 CHF	99.65%	996'500.00	0.21	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.85%	1'008'500.00	0.22	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	1'000	0	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.22	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.10%	1'531'500.00	0.33	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	1'500	0	1'500 CHF	100.30%	1'504'500.00	0.32	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.34%	1'505'115.00	0.32	a)
<b>CA</b>							<b>11'458'990.00</b>	<b>2.46</b>	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	3'200	0	1'700	1'500 CHF	169.60%	2'544'000.00	0.55	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	5'480	0	1'000	4'480 CHF	123.73%	5'543'104.00	1.19	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	2'050	0	0	2'050 CHF	118.38%	2'426'790.00	0.52	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	4'800	0	3'300	1'500 CHF	108.37%	1'625'550.00	0.35	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'300	0	0	1'300 CHF	101.20%	1'315'600.00	0.28	a)
CH0114260257	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 06/28/23 514	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'000	0	0	1'000 CHF	101.55%	1'015'500.00	0.22	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	3'900	0	500	3'400 CHF	109.89%	3'736'260.00	0.80	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	150	0	0	150 CHF	109.72%	164'580.00	0.04	a)
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	10'000	0	1'000	9'000 CHF	103.87%	9'348'300.00	2.00	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	1'000	0	0	1'000 CHF	99.13%	991'300.00	0.21	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	2'000	0	0	2'000 CHF	99.65%	1'993'000.00	0.43	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42	300	0	0	300 CHF	105.20%	315'600.00	0.07	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	1'500	0	0	1'500 CHF	98.68%	1'480'200.00	0.32	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	4'000	0	3'000	1'000 CHF	100.77%	1'007'700.00	0.22	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	2'500	0	0	2'500 CHF	98.95%	2'473'750.00	0.53	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	200	0	0	200 CHF	109.70%	219'400.00	0.05	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	500	0	0	500 CHF	98.75%	493'750.00	0.11	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	600	0	0	600 CHF	98.35%	590'100.00	0.13	a)
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	1'200	0	0	1'200 CHF	99.69%	1'196'280.00	0.26	a)
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	200	0	0	200 CHF	108.75%	217'500.00	0.05	a)
CH0208701380	1.1250 % KBBL 1 1/8 03/27/23	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	2'000	0	0	2'000 CHF	99.70%	1'994'000.00	0.43	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'000	0	0	1'000 CHF	100.10%	1'001'000.00	0.21	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	400	0	0	400 CHF	99.91%	399'640.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0221386144	2.5000 % GEOFIS 2 1/2 09/12/22	1'235	0	1'235	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222705987	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/18/23	1'350	0	0	1'350 CHF	99.99%	1'349'865.00	0.29 a)	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	4'160	0	1'000	3'160 CHF	100.48%	3'175'168.00	0.68 a)	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	1'250	0	0	1'250 CHF	143.49%	1'793'625.00	0.38 a)	
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	5'000	0	500	4'500 CHF	97.23%	4'375'350.00	0.94 a)	
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	2'390	0	0	2'390 CHF	89.44%	2'137'616.00	0.46 a)	
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	7'700	0	2'200	5'500 CHF	94.73%	5'210'150.00	1.12 a)	
CH0228531437	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26	400	0	0	400 CHF	101.00%	404'000.00	0.09 a)	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	2'000	0	0	2'000 CHF	99.66%	1'993'200.00	0.43 a)	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	420	0	420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	1'000	0	0	1'000 CHF	99.45%	994'500.00	0.21 a)	
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	600	0	0	600 CHF	99.10%	594'600.00	0.13 a)	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.25%	982'500.00	0.21 a)	
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.10%	981'000.00	0.21 a)	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	6'000	0	0	6'000 CHF	97.89%	5'873'400.00	1.26 a)	
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	1'250	0	0	1'250 CHF	98.87%	1'235'875.00	0.26 a)	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	1'250	0	0	1'250 CHF	98.60%	1'232'500.00	0.26 a)	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	3'200	0	0	3'200 CHF	98.20%	3'142'400.00	0.67 a)	
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	815	0	815	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	1'500	0	0	1'500 CHF	94.00%	1'410'000.00	0.30 a)	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	1'000	0	0	1'000 CHF	94.61%	946'100.00	0.20 a)	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	2'100	0	0	2'100 CHF	99.11%	2'081'310.00	0.45 a)	
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	3'000	0	500	2'500 CHF	90.05%	2'251'250.00	0.48 a)	
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	0	2'500	0	2'500 CHF	92.65%	2'316'250.00	0.50 a)	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	1'000	0	0	1'000 CHF	98.19%	981'900.00	0.21 a)	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	4'000	0	0	4'000 CHF	96.73%	3'869'200.00	0.83 a)	
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'500	0	0	1'500 CHF	94.80%	1'422'000.00	0.30 a)	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	0	1'000 CHF	99.55%	995'500.00	0.21 a)	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'000	0	1'000	1'000 CHF	93.70%	937'000.00	0.20 a)	
CH0326371439	0.2500 % COOPSW 0 1/4 09/30/22	1'525	0	1'525	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	1'800	0	0	1'800 CHF	94.22%	1'695'960.00	0.36 a)	
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	1'000	0	0	1'000 CHF	94.75%	947'500.00	0.20 a)	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	1'200	0	1'000	200 CHF	97.90%	195'800.00	0.04 a)	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	500	0	0	500 CHF	89.36%	446'800.00	0.10 a)	
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	1'720	0	0	1'720 CHF	91.51%	1'573'972.00	0.34 a)	
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	1'000	0	0	1'000 CHF	96.36%	963'600.00	0.21 a)	
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	1'500	0	0	1'500 CHF	97.25%	1'458'750.00	0.31 a)	
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	750	0	500	250 CHF	94.45%	236'125.00	0.05 a)	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	3'000	0	0	3'000 CHF	95.60%	2'868'000.00	0.61 a)	
CH0357483160	2.0000 % KWLILI 2 12/11/23	700	0	0	700 CHF	99.98%	699'860.00	0.15 a)	
CH0360172750	1.3750 % ELEM 1 3/8 11/02/22	3'315	0	3'315	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	1'000	0	0	1'000 CHF	89.45%	894'500.00	0.19 a)	
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	700	0	0	700 CHF	96.65%	676'550.00	0.14 a)	
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	500	0	0	500 CHF	93.65%	468'250.00	0.10 a)	
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	900	0	0	900 CHF	89.50%	805'500.00	0.17 a)	
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	1'000	0	0	1'000 CHF	94.51%	945'100.00	0.20 a)	
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	500	0	0	500 CHF	94.10%	470'500.00	0.10 a)	
CH0373476768	1.2500 % GRANDX 1 1/4 06/06/23	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	4'000	0	0	4'000 CHF	95.60%	3'824'000.00	0.82 a)	
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	3'500	0	1'500	2'000 CHF	95.35%	1'907'000.00	0.41 a)	
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	1'000	0	0	1'000 CHF	99.01%	990'100.00	0.21 a)	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	1'100	0	1'000	100 CHF	91.84%	91'840.00	0.02 a)	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.35%	963'500.00	0.21 a)	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	2'000	0	0	2'000 CHF	94.75%	1'895'000.00	0.41 a)	
CH0414510054	0.2500 % SCHPSW 0 1/4 06/05/23 MTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	1'600	0	0	1'600 CHF	96.50%	1'544'000.00	0.33 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	1'000	0	0	1'000 CHF	94.25%	942'500.00	0.20	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	2'000	0	0	2'000 CHF	95.95%	1'919'000.00	0.41	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'000	0	0	3'000 CHF	91.20%	2'736'000.00	0.59	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'000	0	0	2'000 CHF	90.90%	1'818'000.00	0.39	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	2'900	0	0	2'900 CHF	91.45%	2'652'050.00	0.57	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'800	0	0	1'800 CHF	89.55%	1'611'900.00	0.35	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	3'000	0	0	3'000 CHF	73.65%	2'209'500.00	0.47	a)
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	2'050	0	2'050	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	0.31	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	1'500	0	0	1'500 CHF	93.86%	1'407'900.00	0.30	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	1'580	0	0	1'580 CHF	90.46%	1'429'268.00	0.31	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	2'200	0	1'200	1'000 CHF	99.01%	990'110.00	0.21	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	1'000	0	0	1'000 CHF	87.60%	876'000.00	0.19	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	2'600	0	0	2'600 CHF	88.00%	2'288'000.00	0.49	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	5'675	0	1'675	4'000 CHF	86.15%	3'446'000.00	0.74	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	2'000	0	0	2'000 CHF	92.80%	1'856'000.00	0.40	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	2'000	0	0	2'000 CHF	88.95%	1'779'000.00	0.38	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	2'000	0	0	2'000 CHF	95.50%	1'910'000.00	0.41	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	2'700	0	500	2'200 CHF	84.25%	1'853'500.00	0.40	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	450	0	0	450 CHF	99.20%	446'400.00	0.10	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	2'500	0	1'500	1'000 CHF	92.80%	928'000.00	0.20	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	2'000	0	0	2'000 CHF	89.85%	1'797'000.00	0.39	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	3'200	0	1'700	1'500 CHF	99.69%	1'495'350.00	0.32	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	2'500	0	0	2'500 CHF	93.35%	2'333'750.00	0.50	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'000	0	0	2'000 CHF	84.25%	1'685'000.00	0.36	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	1'500	0	0	1'500 CHF	92.28%	1'384'200.00	0.30	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	6'000	0	0	6'000 CHF	93.98%	5'638'800.00	1.21	a)
CH0550413360	0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.65%	976'500.00	0.21	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	500	1'100	0	1'600 CHF	68.80%	1'100'800.00	0.24	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	3'000	0	0	3'000 CHF	90.00%	2'700'000.00	0.58	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	2'160	0	0	2'160 CHF	92.30%	1'993'680.00	0.43	a)
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.21	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'500	0	0	1'500 CHF	93.50%	1'402'500.00	0.30	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'000	0	500	500 CHF	90.85%	454'250.00	0.10	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	1'400	0	0	1'400 CHF	89.80%	1'257'200.00	0.27	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	400	0	0	400 CHF	84.50%	338'000.00	0.07	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	1'100	0	0	1'100 CHF	83.95%	923'450.00	0.20	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	1'500	0	0	1'500 CHF	87.30%	1'309'500.00	0.28	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	2'000	0	500	1'500 CHF	91.50%	1'372'500.00	0.29	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	200	0	0	200 CHF	89.30%	178'600.00	0.04	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	5'000	0	0	5'000 CHF	92.60%	4'630'000.00	0.99	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	2'000	0	1'000	1'000 CHF	91.50%	915'000.00	0.20	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	1'500	0	500	1'000 CHF	88.75%	887'500.00	0.19	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	2'000	0	0	2'000 CHF	84.25%	1'685'000.00	0.36	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBNSW 0.1 04/18/31	5'000	0	0	5'000 CHF	87.30%	4'365'000.00	0.94	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	1'000	0	500	500 CHF	95.50%	477'500.00	0.10	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	2'850	0	0	2'850 CHF	87.95%	2'506'575.00	0.54	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	2'600	0	1'000	1'600 CHF	86.90%	1'390'400.00	0.30	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	86.65%	866'500.00	0.19	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.00%	910'000.00	0.19	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	500	0	0	500 CHF	75.70%	378'500.00	0.08	a)
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	0	1'000	0	1'000 CHF	87.65%	876'500.00	0.19	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBNSW 0 1/8 09/15/33	2'000	0	0	2'000 CHF	83.65%	1'673'000.00	0.36	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	1'500	0	0	1'500 CHF	82.65%	1'239'750.00	0.27	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	16'000	0	2'000	14'000 CHF	87.49%	12'248'600.00	2.62	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	5'700	0	0	5'700 CHF	80.50%	4'588'500.00	0.98	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'250	0	0	1'250 CHF	95.65%	1'195'625.00	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	1'500	0	0	1'500 CHF	78.15%	1'172'250.00	0.25	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	2'800	0	500	2'300 CHF	94.90%	2'182'700.00	0.47	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	1'000	0	0	1'000 CHF	86.00%	860'000.00	0.18	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	3'000	0	0	3'000 CHF	88.80%	2'664'000.00	0.57	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	2'350	0	0	2'350 CHF	88.20%	2'072'700.00	0.44	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'000	0	0	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	0.21	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	1'000	0	0	1'000 CHF	93.85%	938'500.00	0.20	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	750	0	0	750 CHF	65.65%	492'375.00	0.11	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	1'400	0	0	1'400 CHF	90.70%	1'269'800.00	0.27	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	2'850	0	2'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'500	0	0	1'500 CHF	85.25%	1'278'750.00	0.27	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	2'000	0	0	2'000 CHF	92.21%	1'844'200.00	0.40	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	2'250	0	0	2'250 CHF	88.05%	1'981'125.00	0.42	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	3'000	0	0	3'000 CHF	86.09%	2'582'580.00	0.55	a)
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	4'000	0	1'000	3'000 CHF	94.50%	2'835'000.00	0.61	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	2'800	0	1'000	1'800 CHF	95.85%	1'725'300.00	0.37	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	1'600	0	500	1'100 CHF	92.85%	1'021'350.00	0.22	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	1'000	0	0	1'000 CHF	89.65%	896'500.00	0.19	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	600	0	0	600 CHF	72.30%	433'800.00	0.09	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	2'000	0	0	2'000 CHF	97.30%	1'946'000.00	0.42	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	11'000	0	500	10'500 CHF	96.39%	10'120'950.00	2.17	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	370	0	370	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	0.74	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	3'000	0	0	3'000 CHF	99.25%	2'917'500.00	0.64	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	0	1'000	0	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	0.21	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	0	2'000	0	2'000 CHF	115.20%	2'304'000.00	0.49	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	2'000	0	0	2'000 CHF	102.51%	2'050'200.00	0.44	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	0	1'500	0	1'500 CHF	99.70%	1'495'500.00	0.32	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	0	1'000	0	1'000 CHF	103.95%	1'039'500.00	0.22	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	0	2'500	0	2'500 CHF	104.61%	2'615'250.00	0.56	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	0	750	0	750 CHF	102.90%	771'750.00	0.17	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	0	1'000	0	1'000 CHF	102.85%	1'028'500.00	0.22	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	0	800	0	800 CHF	108.50%	868'000.00	0.19	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	1'000	0	0	1'000 CHF	99.70%	997'000.00	0.21	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	0	1'400	0	1'400 CHF	101.95%	1'427'300.00	0.31	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	0	4'000	0	4'000 CHF	103.10%	4'124'000.00	0.88	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.45%	1'506'750.00	0.32	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	0	1'470	500	970 CHF	103.58%	1'004'726.00	0.22	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	1'335	500	835 CHF	102.25%	853'787.50	0.18	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	1'000	0	1'000 CHF	100.40%	1'004'000.00	0.22	a)
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	0	825	0	825 CHF	100.41%	828'382.50	0.18	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	450	0	450 CHF	100.85%	453'825.00	0.10	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	0	1'000	0	1'000 CHF	99.90%	999'000.00	0.21	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	0	680	0	680 CHF	105.90%	720'120.00	0.15	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	0	1'000	0	1'000 CHF	106.30%	1'063'000.00	0.23	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	1'000	0	1'000 CHF	116.85%	1'168'500.00	0.25	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	1'225	0	1'225 CHF	102.61%	1'256'972.50	0.27	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	0	1'500	0	1'500 CHF	101.65%	1'524'750.00	0.33	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	0	750	0	750 CHF	104.85%	786'375.00	0.17	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLILJ 2 3/4 03/01/30	0	1'000	0	1'000 CHF	102.70%	1'027'000.00	0.22	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	0	1'000	0	1'000 CHF	101.16%	1'011'600.00	0.22	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	0	930	0	930 CHF	100.75%	936'975.00	0.20	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	200	0	200 CHF	101.40%	202'800.00	0.04	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	0	1'000	0	1'000 CHF	100.25%	1'002'500.00	0.21	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	0	750	0	750 CHF	103.15%	773'625.00	0.17	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	825	0	825 CHF	104.63%	863'197.50	0.18	a)
CH1255924479	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29 APR	0	930	930	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
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	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1264887428	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31 JULY	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	0	700	0	700 CHF	103.35%	723'450.00	0.15	a)
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	1'000	0	1'000 CHF	103.80%	1'038'000.00	0.22	a)
CH1266847180	1.7000 % EGW 1.7 07/20/43 69	0	900	0	900 CHF	101.95%	917'550.00	0.20	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	0	1'000	0	1'000 CHF	102.10%	1'021'000.00	0.22	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	1'500	0	1'500 CHF	99.95%	1'499'250.00	0.32	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	750	0	750 CHF	105.10%	788'250.00	0.17	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	1'500	0	1'500 CHF	106.01%	1'590'150.00	0.34	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	1'000	0	1'000 CHF	101.20%	1'012'000.00	0.22	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	525	0	525 CHF	103.50%	543'375.00	0.12	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	2'600	0	2'600 CHF	103.57%	2'692'820.00	0.58	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	1'000	0	1'000 CHF	101.02%	1'010'160.00	0.22	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	0	750	0	750 CHF	99.90%	749'272.50	0.16	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	0	600	0	600 CHF	101.42%	608'508.00	0.13	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	750	0	750 CHF	100.44%	753'307.50	0.16	a)
<b>CH</b>							<b>325'410'637.00</b>	<b>69.72</b>	
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.25%	1'845'000.00	0.40	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	92.85%	1'392'750.00	0.30	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	0	750	0	750 CHF	100.90%	756'750.00	0.16	a)
<b>CL</b>							<b>3'994'500.00</b>	<b>0.86</b>	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	1'320	0	0	1'320 CHF	99.40%	1'312'080.00	0.28	a)
CH0465347661	1.6250 % DB 1 5/8 09/12/22 EMTN	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	0	700	0	700 CHF	81.20%	568'400.00	0.12	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	88.70%	887'000.00	0.19	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	108.25%	3'247'500.00	0.70	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.35%	1'003'500.00	0.21	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.93%	1'009'280.00	0.22	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	1'000	0	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.22	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.08%	1'000'820.00	0.21	a)
<b>DE</b>							<b>10'050'580.00</b>	<b>2.15</b>	
CH0474977912	0.6250 % DANBNK 0 5/8 11/24/22 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>DK</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	3'750	0	750	3'000 CHF	96.45%	2'893'500.00	0.62	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'000	0	500	500 CHF	90.50%	452'500.00	0.10	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.00%	1'000'000.00	0.21	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	1'000	500	500 CHF	100.40%	502'000.00	0.11	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCEF 2.7325 07/04/25 EMTN	0	750	0	750 CHF	100.85%	756'375.00	0.16	a)
<b>ES</b>							<b>5'604'375.00</b>	<b>1.20</b>	
CH0545766534	0.1250 % NDASS 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'500	0	1'500	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	0.30	a)
<b>FI</b>							<b>1'410'500.00</b>	<b>0.30</b>	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	101.60%	1'219'200.00	0.26	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	99.00%	2'574'000.00	0.55	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	600	0	0	600 CHF	93.90%	563'400.00	0.12	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	92.10%	2'763'000.00	0.59	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 CHF	88.95%	1'779'000.00	0.38	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	91.90%	1'838'000.00	0.39	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	2'000	0	1'500	500 CHF	91.10%	455'500.00	0.10	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	0	1'000	500	500 CHF	100.00%	500'000.00	0.11	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.20%	1'002'000.00	0.21	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.40%	1'014'000.00	0.22	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.35%	1'003'500.00	0.21	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.40%	1'004'000.00	0.22	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.00%	3'000'000.00	0.64	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.75%	1'017'500.00	0.22	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.60%	1'026'000.00	0.22	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	102.05%	2'041'000.00	0.44	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.95%	1'029'500.00	0.22	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.25%	2'005'000.00	0.43	a)
<b>FR</b>							<b>26'844'100.00</b>	<b>5.75</b>	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	3'150	0	650	2'500 CHF	98.10%	2'452'500.00	0.53	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	86.65%	2'252'900.00	0.48	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.21	a)
CH1204175124	1.9150 % NWISE 1.915 09/08/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	96.95%	1'454'250.00	0.31	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.70%	805'600.00	0.17	a)
CH1236363417	2.0125 % NWISE 2.0125 01/23/30	0	1'500	0	1'500 CHF	100.75%	1'511'250.00	0.32	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	101.05%	606'300.00	0.13	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.10%	1'501'499.85	0.32	a)
CH1280994299	2.9700 % NWISE 2.97 09/08/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.24%	801'920.00	0.17	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.17%	1'001'730.00	0.21	a)
<b>GB</b>							<b>13'361'949.85</b>	<b>2.86</b>	
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.04%	800'320.00	0.17	a)
<b>KR</b>							<b>800'320.00</b>	<b>0.17</b>	
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	99.27%	1'985'400.00	0.43	a)
<b>KY</b>							<b>1'985'400.00</b>	<b>0.43</b>	
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.22	a)
<b>LI</b>							<b>1'023'000.00</b>	<b>0.22</b>	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	4'000	0	2'500	1'500 CHF	92.70%	1'390'500.00	0.30	a)
<b>LU</b>							<b>1'390'500.00</b>	<b>0.30</b>	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	400	0	0	400 CHF	87.10%	348'400.00	0.07	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	101.15%	1'416'100.00	0.30	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.25%	802'000.00	0.17	a)
<b>NL</b>							<b>2'566'500.00</b>	<b>0.55</b>	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	96.50%	1'254'500.00	0.27	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	0	500	0	500 CHF	98.60%	493'000.00	0.11	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	100.15%	1'402'100.00	0.30	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	750	0	750 CHF	101.35%	760'125.00	0.16	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.65%	805'200.00	0.17	a)
<b>NO</b>							<b>4'714'925.00</b>	<b>1.01</b>	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	3'000	0	500	2'500 CHF	88.80%	2'220'000.00	0.48	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.65%	1'509'750.00	0.32	a)
<b>NZ</b>							<b>3'729'750.00</b>	<b>0.80</b>	
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	1'300	0	500	800 CHF	97.05%	776'400.00	0.17	a)
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.40%	1'536'000.00	0.33	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.80%	806'400.00	0.17	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.15%	2'023'000.00	0.43	a)
<b>SE</b>							<b>5'141'800.00</b>	<b>1.10</b>	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	0	1'000	0	1'000 CHF	99.30%	993'000.00	0.21	a)
<b>SG</b>							<b>993'000.00</b>	<b>0.21</b>	
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	3'500	0	2'000	1'500 CHF	99.35%	1'490'250.00	0.32	a)
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	99.74%	1'994'800.00	0.43	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	2'000	0	1'000	1'000 CHF	98.01%	980'100.00	0.21	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	98.75%	897'500.00	0.19	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.00%	880'000.00	0.19	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	88.35%	3'092'250.00	0.66	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	88.70%	3'548'000.00	0.76	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	99.80%	3'193'600.00	0.68	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	700	0	700 CHF	100.71%	704'997.93	0.15	a)
<b>US</b>							<b>16'781'497.93</b>	<b>3.60</b>	
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	1'600	0	0	1'600 CHF	103.55%	1'656'800.00	0.35	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	84.65%	1'693'000.00	0.36	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	93.80%	2'345'000.00	0.50	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.35%	1'003'500.00	0.21	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.80%	1'512'000.00	0.32	a)
CH1271360575	1.7500 % AIB 1 3/4 06/26/30	0	1'000	0	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.22	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	0	750	0	750 CHF	101.20%	759'000.00	0.16	a)
<b>XS</b>							<b>9'979'800.00</b>	<b>2.14</b>	

<b>Vermögensaufstellung</b>		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		1'414'724.82	0.30
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		462'598'024.78	99.11
Sonstige Vermögenswerte		2'736'883.46	0.59
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>466'749'633.06</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten		-15'709.42	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>466'733'923.64</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		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);	462'598'024.78	99.11
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: 01.09.2022 - 31.08.2023

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: 01.09.2022 - 31.08.2023

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 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	0.25000	0.08750	0.16250

## 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	0.27099	0.09484	0.17615
It	Nein	CHF	0.65148	0.22801	0.42347
Nt	Nein	CHF	0.78442	0.27454	0.50988

## 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 Schuldner 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