

BEKB OBLIGATIONEN NACHHALTIG CHF

Halbjahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
A	36597695	CHF
B	36597693	CHF
lt	36597689	CHF
Nt	36597692	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter 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	14
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Fussnoten	16
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17

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
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		469'758'362.81	466'733'923.64	423'742'013.16	369'836'913.81
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'411'445.68	1'249'307.67	359'541.17	463'347.20
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		15'530.017	14'072.470	4'105.000	4'680.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		90.89	88.78	87.59	99.01
Ausschüttung je Anteil		-	0.25	0.10	0.40
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'181'786.79	937'181.38	741'571.22	611'499.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'808.802	10'416.802	8'359.851	6'115.851
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		92.26	89.97	88.71	99.99
Thesaurierung je Anteil		-	0.27	0.13	0.34
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'714'928.96	21'322'682.95	23'192'797.38	26'485'343.02
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		259'485.000	229'735.000	254'095.000	258'119.659
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		95.25	92.81	91.28	102.61
Thesaurierung je Anteil		-	0.65	0.53	0.77
Total Expense Ratio (TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
Klasse Nt	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		442'450'201.38	443'224'751.64	399'448'103.39	342'276'723.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'714'298.423	4'847'561.759	4'446'888.853	3'393'112.068
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		93.85	91.43	89.83	100.87
Thesaurierung je Anteil		-	0.78	0.67	0.91
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	2.66 %	7.23 %	-12.14 %	-2.38 %
Klasse B	2.65 %	7.23 %	-12.15 %	-2.37 %
Klasse It	2.87 %	7.67 %	-11.78 %	-1.98 %
Klasse Nt	2.95 %	7.83 %	-11.63 %	-1.82 %
Benchmark	2.55 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error ³³⁾	-	-	0.61 %	0.14 %

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	0.11 %
Klasse B	0.10 %
Klasse It	0.32 %
Klasse Nt	0.40 %

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	4'237'850.40	1'414'724.82
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	461'604'594.50	462'598'024.78
Sonstige Vermögenswerte	3'931'205.71	2'736'883.46
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	469'773'650.61	466'749'633.06
Andere Verbindlichkeiten	-15'287.80	-15'709.42
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	469'758'362.81	466'733'923.64

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'072.470	4'105.000
Ausgegebene Anteile		1'572.547	11'567.470
Zurückgenommene Anteile		-115.000	-1'600.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		15'530.017	14'072.470
Klasse B			
	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'416.802	8'359.851
Ausgegebene Anteile		2'392.000	3'656.951
Zurückgenommene Anteile		-	-1'600.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'808.802	10'416.802
Klasse It			
	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		229'735.000	254'095.000
Ausgegebene Anteile		31'000.000	3'800.000
Zurückgenommene Anteile		-1'250.000	-28'160.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		259'485.000	229'735.000
Klasse Nt			
	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'847'561.759	4'446'888.853
Ausgegebene Anteile		416'243.161	1'284'882.716
Zurückgenommene Anteile		-549'506.497	-884'209.810
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'714'298.423	4'847'561.759

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		466'733'923.64	423'742'013.16
Ausbezahlte Ausschüttung		-3'911.26	-410.50
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'391'397.88	-1'113'747.98
Saldo aus dem Anteilverkehr		-9'477'904.43	34'924'572.73
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		13'897'652.74	9'181'496.23
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		469'758'362.81	466'733'923.64

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		19'910.35	8'104.15
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-1'356.80
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'649'626.43	3'841'976.31
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		116'488.46	559'343.43
Total Ertrag		2'786'025.24	4'408'067.09
Aufwand			
Passivzinsen		-0.20	0.00
Reglementarische Vergütungen		-93'932.34	-171'107.32
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-130'099.79	-277'863.00
Total Aufwand		-224'032.33	-448'970.32
Nettoertrag / Verlust			
		2'561'992.91	3'959'096.77
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'853'369.24	-8'212'027.53
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		277'330.11	471'947.71
Realisierter Erfolg		-1'014'046.22	-3'780'983.05
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		14'911'698.96	12'962'479.28
Gesamterfolg		13'897'652.74	9'181'496.23

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.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							461'604'594.50	98.26	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							461'604'594.50	98.26	
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	103.05%	1'030'500.00	0.22	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	750	0	0	750 CHF	101.85%	763'875.00	0.16	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.22	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.25%	2'025'000.00	0.43	a)
CH1271007952	2.3750 % HYN0E 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.22	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	750	0	0	750 CHF	102.05%	765'375.00	0.16	a)
AT							6'606'750.00	1.41	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.75%	987'500.00	0.21	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'000	0	500	1'500 CHF	94.10%	1'411'500.00	0.30	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'500	0	0	2'500 CHF	101.40%	2'535'000.00	0.54	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	1'000	0	0	1'000 CHF	102.95%	1'029'500.00	0.22	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	102.75%	2'568'750.00	0.55	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.80%	1'028'000.00	0.22	a)
AU							9'560'250.00	2.04	
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	1'250	0	500	750 CHF	101.80%	763'500.00	0.16	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	1'000	0	0	1'000 CHF	100.85%	1'008'500.00	0.21	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.25%	1'022'500.00	0.22	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	1'000	0	0	1'000 CHF	102.15%	1'021'500.00	0.22	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	103.45%	1'551'750.00	0.33	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	1'500	0	0	1'500 CHF	101.60%	1'524'000.00	0.32	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.20%	1'518'000.00	0.32	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	750	0	750 CHF	102.25%	766'875.00	0.16	a)
CA							9'176'625.00	1.95	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	1'500	0	0	1'500 CHF	171.70%	2'575'500.00	0.55	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	4'480	0	0	4'480 CHF	123.29%	5'523'392.00	1.18	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	2'050	1'000	0	3'050 CHF	119.47%	3'643'835.00	0.78	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	1'500	0	0	1'500 CHF	107.44%	1'611'600.00	0.34	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'300	0	0	1'300 CHF	101.14%	1'314'820.00	0.28	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'000	0	0	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.22	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	3'400	0	900	2'500 CHF	110.15%	2'753'750.00	0.59	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	150	0	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	9'000	0	1'000	8'000 CHF	105.49%	8'439'200.00	1.80	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	1'000	0	0	1'000 CHF	100.66%	1'006'600.00	0.21	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	2'000	0	0	2'000 CHF	101.50%	2'030'000.00	0.43	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 03/27/42	300	0	0	300 CHF	109.90%	329'700.00	0.07	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	1'500	0	0	1'500 CHF	100.13%	1'501'950.00	0.32	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	2'500	0	0	2'500 CHF	100.81%	2'520'250.00	0.54	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLILJ 3 09/27/52	200	0	0	200 CHF	111.80%	223'600.00	0.05	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	500	0	0	500 CHF	99.55%	497'750.00	0.11	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	600	0	0	600 CHF	100.15%	600'900.00	0.13	a)
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208271541	3.0000 % KWLILJ 3 04/02/48	200	0	0	200 CHF	111.75%	223'500.00	0.05	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	2'000	0	0	2'000 CHF	101.63%	2'032'600.00	0.43	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222705987	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/18/23	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	3'160	0	0	3'160 CHF	100.51%	3'176'116.00	0.68	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	1'250	0	0	1'250 CHF	148.54%	1'856'750.00	0.40	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	4'500	0	0	4'500 CHF	98.17%	4'417'650.00	0.94	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.
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	2'390	0	890	1'500 CHF	93.55%	1'403'250.00	0.30	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	5'500	0	0	5'500 CHF	95.64%	5'260'200.00	1.12	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26	400	0	0	400 CHF	101.75%	407'000.00	0.09	a)
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	2'000	0	0	2'000 CHF	100.62%	2'012'400.00	0.43	a)
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	1'000	0	0	1'000 CHF	99.84%	998'400.00	0.21	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	6'000	0	0	6'000 CHF	99.22%	5'953'200.00	1.27	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 3/4 09/23/24 456	1'250	0	0	1'250 CHF	99.50%	1'243'750.00	0.26	a)
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	3'200	0	0	3'200 CHF	99.13%	3'172'160.00	0.68	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	1'500	0	0	1'500 CHF	96.15%	1'442'250.00	0.31	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	1'000	0	0	1'000 CHF	96.66%	966'600.00	0.21	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	2'100	0	0	2'100 CHF	99.96%	2'099'160.00	0.45	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	2'500	0	1'000	1'500 CHF	92.47%	1'387'050.00	0.30	a)
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	2'500	0	0	2'500 CHF	94.90%	2'372'500.00	0.51	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	4'000	0	2'000	2'000 CHF	98.15%	1'963'000.00	0.42	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'500	0	0	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.31	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	0	1'000 CHF	100.70%	1'007'000.00	0.21	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	1'800	0	0	1'800 CHF	96.24%	1'732'320.00	0.37	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	1'000	0	0	1'000 CHF	96.64%	966'400.00	0.21	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	500	500	0	1'000 CHF	93.25%	932'500.00	0.20	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	1'720	780	0	2'500 CHF	93.68%	2'342'000.00	0.50	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	1'000	0	0	1'000 CHF	97.36%	973'600.00	0.21	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	1'500	0	0	1'500 CHF	98.46%	1'476'900.00	0.31	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLILI 2 12/11/23	700	0	700	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	92.00%	920'000.00	0.20	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	700	0	0	700 CHF	98.05%	686'350.00	0.15	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	900	0	0	900 CHF	92.25%	830'250.00	0.18	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	1'000	0	0	1'000 CHF	96.63%	966'300.00	0.21	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	500	0	500	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	97.31%	3'892'400.00	0.83	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	2'000	0	0	2'000 CHF	96.95%	1'939'000.00	0.41	a)
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	1'000	0	0	1'000 CHF	99.65%	996'500.00	0.21	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	100	0	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.21	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	2'000	0	0	2'000 CHF	97.00%	1'940'000.00	0.41	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	1'600	0	0	1'600 CHF	98.70%	1'579'200.00	0.34	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.30%	963'000.00	0.20	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	2'000	0	0	2'000 CHF	97.45%	1'949'000.00	0.41	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'000	0	0	3'000 CHF	93.55%	2'806'500.00	0.60	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'000	0	0	2'000 CHF	93.25%	1'865'000.00	0.40	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	2'900	0	0	2'900 CHF	95.00%	2'755'000.00	0.59	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'800	0	0	1'800 CHF	92.20%	1'659'600.00	0.35	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	3'000	0	1'000	2'000 CHF	77.90%	1'558'000.00	0.33	a)
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	1'500	0	0	1'500 CHF	98.09%	1'471'350.00	0.31	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	1'500	0	0	1'500 CHF	96.06%	1'440'900.00	0.31	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	0	600	0	600 CHF	99.65%	597'900.00	0.13	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	0	750	0	750 CHF	94.03%	705'225.00	0.15	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	1'580	0	0	1'580 CHF	91.96%	1'452'968.00	0.31	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	0	1'500	0	1'500 CHF	88.00%	1'320'000.00	0.28	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	0	1'000	0	1'000 CHF	109.40%	1'094'000.00	0.23	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	1'000	0	0	1'000 CHF	90.60%	906'000.00	0.19	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	2'600	0	0	2'600 CHF	90.60%	2'355'600.00	0.50	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	4'000	0	0	4'000 CHF	88.90%	3'556'000.00	0.76	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	2'000	0	0	2'000 CHF	94.75%	1'895'000.00	0.40	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	2'000	0	0	2'000 CHF	91.60%	1'832'000.00	0.39	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	2'000	0	0	2'000 CHF	96.85%	1'937'000.00	0.41	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	2'200	0	0	2'200 CHF	86.45%	1'901'900.00	0.40	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	450	0	0	450 CHF	102.30%	460'350.00	0.10	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	1'000	0	0	1'000 CHF	94.84%	948'400.00	0.20	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	2'000	0	0	2'000 CHF	92.31%	1'846'200.00	0.39	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	2'500	0	0	2'500 CHF	95.10%	2'377'500.00	0.51	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'000	0	0	2'000 CHF	86.95%	1'739'000.00	0.37	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	1'500	0	0	1'500 CHF	94.47%	1'417'050.00	0.30	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	6'000	0	0	6'000 CHF	95.98%	5'758'800.00	1.23	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.90%	989'000.00	0.21	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	1'600	0	0	1'600 CHF	72.35%	1'157'600.00	0.25	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	3'000	0	0	3'000 CHF	92.50%	2'775'000.00	0.59	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	2'160	0	0	2'160 CHF	94.18%	2'034'288.00	0.43	a)
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	750	0	750 CHF	108.04%	810'300.00	0.17	a)
CH0557778872	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 OCT	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778906	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 NOV	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778914	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 DEC	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778922	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 JAN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778930	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 JAN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778955	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45 FEB	0	780	780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.21	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'500	0	0	1'500 CHF	96.10%	1'441'500.00	0.31	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	500	0	0	500 CHF	93.60%	468'000.00	0.10	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	1'400	0	0	1'400 CHF	93.75%	1'312'500.00	0.28	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	1'100	0	0	1'100 CHF	86.60%	952'600.00	0.20	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	1'500	0	0	1'500 CHF	90.85%	1'362'750.00	0.29	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	1'500	0	0	1'500 CHF	94.05%	1'410'750.00	0.30	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	5'000	0	0	5'000 CHF	94.82%	4'741'000.00	1.01	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	1'000	0	0	1'000 CHF	91.33%	913'300.00	0.19	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	2'000	0	0	2'000 CHF	86.82%	1'736'400.00	0.37	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31	5'000	0	2'000	3'000 CHF	90.50%	2'715'000.00	0.58	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	500	0	0	500 CHF	96.75%	483'750.00	0.10	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	2'850	0	850	2'000 CHF	91.55%	1'831'000.00	0.39	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	1'600	0	0	1'600 CHF	89.80%	1'436'800.00	0.31	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.70%	887'000.00	0.19	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.65%	936'500.00	0.20	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	1'000	0	0	1'000 CHF	91.20%	912'000.00	0.19	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33	2'000	0	0	2'000 CHF	86.80%	1'736'000.00	0.37	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	1'500	0	0	1'500 CHF	86.20%	1'293'000.00	0.28	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	14'000	0	2'000	12'000 CHF	90.33%	10'839'600.00	2.31	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	5'700	0	2'200	3'500 CHF	83.20%	2'912'000.00	0.62	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'250	0	0	1'250 CHF	97.60%	1'220'000.00	0.26	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	1'500	0	0	1'500 CHF	83.60%	1'254'000.00	0.27	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	2'300	0	0	2'300 CHF	96.65%	2'222'950.00	0.47	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	1'000	0	0	1'000 CHF	87.40%	874'000.00	0.19	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	3'000	0	0	3'000 CHF	91.45%	2'743'500.00	0.58	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	2'350	0	850	1'500 CHF	92.40%	1'386'000.00	0.30	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	1'000	0	0	1'000 CHF	95.95%	959'500.00	0.20	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	750	0	0	750 CHF	73.25%	549'375.00	0.12	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	1'400	0	0	1'400 CHF	93.90%	1'314'600.00	0.28	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'500	0	0	1'500 CHF	90.50%	1'357'500.00	0.29	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.
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	2'000	0	1'000	1'000 CHF	94.67%	946'700.00	0.20	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	2'250	0	0	2'250 CHF	90.67%	2'040'075.00	0.43	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	3'000	0	0	3'000 CHF	90.65%	2'719'620.00	0.58	a)
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	3'000	0	0	3'000 CHF	97.00%	2'910'000.00	0.62	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	1'800	0	300	1'500 CHF	97.80%	1'467'000.00	0.31	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	1'100	0	0	1'100 CHF	95.85%	1'054'350.00	0.22	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	1'000	0	0	1'000 CHF	94.15%	941'500.00	0.20	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	600	0	0	600 CHF	79.45%	476'700.00	0.10	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	2'000	0	0	2'000 CHF	99.85%	1'997'000.00	0.43	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	10'500	0	0	10'500 CHF	99.55%	10'452'750.00	2.23	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	0.75	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	3'000	0	0	3'000 CHF	104.05%	3'121'500.00	0.66	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	1'000	0	0	1'000 CHF	101.85%	1'018'500.00	0.22	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	2'000	0	0	2'000 CHF	119.87%	2'397'400.00	0.51	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	2'000	0	0	2'000 CHF	104.70%	2'094'000.00	0.45	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	1'000	0	0	1'000 CHF	105.70%	1'057'000.00	0.23	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	2'500	0	0	2'500 CHF	107.35%	2'683'750.00	0.57	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	750	0	0	750 CHF	103.95%	779'625.00	0.17	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	800	0	0	800 CHF	110.81%	886'480.00	0.19	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	1'000	0	0	1'000 CHF	101.85%	1'018'500.00	0.22	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	1'400	0	0	1'400 CHF	102.95%	1'441'300.00	0.31	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	4'000	0	0	4'000 CHF	105.20%	4'208'000.00	0.90	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.80%	1'527'000.00	0.33	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	970	0	0	970 CHF	105.60%	1'024'320.00	0.22	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	835	0	835	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	825	0	0	825 CHF	100.60%	829'950.00	0.18	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	450	0	0	450 CHF	102.65%	461'925.00	0.10	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	1'000	0	0	1'000 CHF	103.05%	1'030'500.00	0.22	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	680	0	0	680 CHF	108.47%	737'596.00	0.16	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	1'000	0	0	1'000 CHF	110.75%	1'107'500.00	0.24	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	1'000	0	0	1'000 CHF	120.95%	1'209'500.00	0.26	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	1'225	0	225	1'000 CHF	104.96%	1'049'600.00	0.22	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	1'500	0	0	1'500 CHF	103.75%	1'556'250.00	0.33	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	750	0	0	750 CHF	106.45%	798'375.00	0.17	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLLI 2 3/4 03/01/30	1'000	0	0	1'000 CHF	105.50%	1'055'000.00	0.22	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	1'000	0	0	1'000 CHF	103.25%	1'032'500.00	0.22	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	930	0	0	930 CHF	101.30%	942'090.00	0.20	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	200	0	0	200 CHF	103.05%	206'100.00	0.04	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	1'000	0	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.22	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	750	0	0	750 CHF	106.35%	797'625.00	0.17	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	825	0	0	825 CHF	106.67%	880'027.50	0.19	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	750	0	750 CHF	101.95%	764'625.00	0.16	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	700	0	0	700 CHF	108.75%	761'250.00	0.16	a)
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	1'000	0	0	1'000 CHF	108.75%	1'087'500.00	0.23	a)
CH1266847180	1.7000 % EGW 1.7 07/20/43 69	900	0	0	900 CHF	107.30%	965'700.00	0.21	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	1'000	1'500	0	2'500 CHF	103.62%	2'590'500.00	0.55	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	1'500	0	0	1'500 CHF	101.00%	1'515'000.00	0.32	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	750	0	0	750 CHF	107.63%	807'225.00	0.17	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	1'500	0	0	1'500 CHF	109.98%	1'649'700.00	0.35	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	750	0	750 CHF	102.72%	770'400.00	0.16	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	1'000	0	0	1'000 CHF	104.30%	1'043'000.00	0.22	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	525	0	0	525 CHF	106.20%	557'550.00	0.12	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	2'600	0	0	2'600 CHF	105.75%	2'749'500.00	0.59	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	1'000	0	1'000 CHF	102.72%	1'027'200.00	0.22	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	500	0	500 CHF	106.51%	532'550.00	0.11	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	1'000	0	0	1'000 CHF	103.25%	1'032'500.00	0.22	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	750	0	0	750 CHF	102.10%	765'750.00	0.16	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	500	0	500 CHF	103.05%	515'250.00	0.11	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.
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	1'300	0	1'300 CHF	106.20%	1'380'600.00	0.29	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	410	0	410 CHF	89.20%	365'720.00	0.08	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	750	0	750 CHF	101.70%	762'750.00	0.16	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	0	800	0	800 CHF	103.65%	829'200.00	0.18	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	1'500	0	1'500 CHF	104.50%	1'567'500.00	0.33	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	600	0	0	600 CHF	105.90%	635'400.00	0.14	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	790	0	790 CHF	104.75%	827'525.00	0.18	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	1'000	0	1'000 CHF	109.55%	1'095'500.00	0.23	a)
CH1296291029	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 DEC	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	1'500	0	1'500 CHF	103.60%	1'554'000.00	0.33	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	500	0	500 CHF	101.90%	509'500.00	0.11	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	400	0	400 CHF	105.00%	420'000.00	0.09	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	800	0	800 CHF	106.00%	848'000.00	0.18	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	750	0	750 CHF	101.95%	764'625.00	0.16	a)
CH1305916855	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 DEC	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117024	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 NOV	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	0	1'000	0	1'000 CHF	101.60%	1'016'000.00	0.22	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	750	0	750 CHF	99.95%	749'625.00	0.16	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	470	0	470 CHF	99.75%	468'825.00	0.10	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	250	0	250 CHF	101.20%	253'000.00	0.05	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLIU 2 3/8 12/05/29	0	870	0	870 CHF	103.25%	898'275.00	0.19	a)
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	550	0	550 CHF	102.70%	564'850.00	0.12	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	425	0	425 CHF	101.55%	431'587.50	0.09	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	330	0	330 CHF	102.00%	336'600.00	0.07	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	600	0	600 CHF	99.80%	598'800.00	0.13	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	1'000	0	1'000 CHF	100.25%	1'002'500.00	0.21	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	0	1'000	0	1'000 CHF	101.00%	1'010'000.00	0.21	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	500	0	500 CHF	101.28%	506'400.00	0.11	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	345	0	345 CHF	102.70%	354'315.00	0.08	a)
CH							322'503'015.00	68.65	
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.75%	1'895'000.00	0.40	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	95.25%	1'428'750.00	0.30	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	750	0	0	750 CHF	100.89%	756'675.00	0.16	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	1'000	0	1'000 CHF	102.60%	1'026'000.00	0.22	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	750	0	750 CHF	100.55%	754'125.00	0.16	a)
CL							5'860'550.00	1.25	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	1'320	0	1'320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.35%	913'500.00	0.19	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	113.15%	3'394'500.00	0.72	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	104.70%	1'047'000.00	0.22	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	1'000	0	0	1'000 CHF	104.60%	1'046'000.00	0.22	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.45%	1'014'500.00	0.22	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.70%	1'017'000.00	0.22	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	101.85%	611'100.00	0.13	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	900	0	900 CHF	104.25%	938'250.00	0.20	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	700	0	700 CHF	100.65%	704'550.00	0.15	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	700	0	700 CHF	101.00%	707'000.00	0.15	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.22	a)
DE							12'405'900.00	2.64	
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	0	1'500	0	1'500 CHF	102.45%	1'536'750.00	0.33	a)
DK							1'536'750.00	0.33	
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	97.95%	2'938'500.00	0.63	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.22	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	500	0	0	500 CHF	101.25%	506'250.00	0.11	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.
CH1276269755	2.7325 % SANSCEF 2.7325 07/04/25 EMTN	750	0	0	750 CHF	101.32%	759'900.00	0.16	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.52%	1'015'160.00	0.22	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	750	0	750 CHF	102.02%	765'172.50	0.16	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.61%	804'912.00	0.17	a)
ES							7'800'394.50	1.66	
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.35%	1'432'900.00	0.31	a)
FI							1'432'900.00	0.31	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	2'600	0	600	2'000 CHF	99.77%	1'995'400.00	0.42	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	600	0	0	600 CHF	96.15%	576'900.00	0.12	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 CHF	94.30%	1'886'000.00	0.40	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.00%	1'840'000.00	0.39	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.55%	1'891'000.00	0.40	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	500	0	0	500 CHF	93.85%	469'250.00	0.10	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	500	0	0	500 CHF	101.50%	507'500.00	0.11	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.60%	1'016'000.00	0.22	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	103.40%	1'034'000.00	0.22	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.15%	1'021'500.00	0.22	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	0.22	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.50%	1'025'000.00	0.22	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.65%	3'049'500.00	0.65	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	104.10%	1'041'000.00	0.22	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	105.15%	1'051'500.00	0.22	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	104.85%	2'097'000.00	0.45	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	105.25%	1'052'500.00	0.22	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.90%	2'038'000.00	0.43	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.75%	1'017'500.00	0.22	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.47%	1'004'700.00	0.21	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	750	0	750 CHF	102.55%	769'125.00	0.16	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	750	0	750 CHF	103.85%	778'875.00	0.17	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	750	0	750 CHF	100.25%	751'875.00	0.16	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	750	0	750 CHF	102.25%	766'875.00	0.16	a)
FR							29'697'500.00	6.32	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	98.98%	2'474'500.00	0.53	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	89.90%	2'337'400.00	0.50	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.21	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	100.10%	1'501'500.00	0.32	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	103.10%	824'800.00	0.18	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	1'500	0	0	1'500 CHF	102.70%	1'540'500.00	0.33	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	600	0	0	600 CHF	103.75%	622'500.00	0.13	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.30%	1'519'500.00	0.32	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	102.35%	818'800.00	0.17	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.22	a)
GB							13'638'000.00	2.90	
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	100.75%	806'000.00	0.17	a)
KR							806'000.00	0.17	
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	105.30%	1'053'000.00	0.22	a)
LI							1'053'000.00	0.22	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	1'500	0	800	700 CHF	96.87%	678'090.00	0.14	a)
LU							678'090.00	0.14	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	400	0	0	400 CHF	91.40%	365'600.00	0.08	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.05%	1'428'700.00	0.30	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	100.86%	806'880.00	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.
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	700	0	700 CHF	101.60%	711'200.00	0.15	a)
NL							3'312'380.00	0.71	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	98.40%	1'279'200.00	0.27	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	500	0	0	500 CHF	100.00%	500'000.00	0.11	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.20%	1'430'800.00	0.30	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	750	0	0	750 CHF	102.60%	769'500.00	0.16	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	800	0	0	800 CHF	101.50%	812'000.00	0.17	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.70%	1'525'500.00	0.32	a)
NO							6'317'000.00	1.34	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	92.15%	1'382'250.00	0.29	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	103.30%	1'549'500.00	0.33	a)
NZ							2'931'750.00	0.62	
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	103.85%	1'557'750.00	0.33	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	800	0	0	800 CHF	102.65%	821'200.00	0.17	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.60%	2'052'000.00	0.44	a)
SE							4'430'950.00	0.94	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	1'000	0	0	1'000 CHF	99.85%	998'500.00	0.21	a)
SG							998'500.00	0.21	
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.65%	916'500.00	0.20	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	91.85%	3'214'750.00	0.68	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	92.95%	3'718'000.00	0.79	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	101.40%	3'244'800.00	0.69	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	700	0	0	700 CHF	103.65%	725'550.00	0.15	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	0	500	0	500 CHF	100.77%	503'870.00	0.11	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	1'000	0	1'000 CHF	101.28%	1'012'820.00	0.22	a)
US							13'336'290.00	2.84	
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	86.45%	1'729'000.00	0.37	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	2'500	0	1'000	1'500 CHF	95.95%	1'439'250.00	0.31	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.95%	1'019'500.00	0.22	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	102.35%	1'535'250.00	0.33	a)
CH1271360575	1.7500 % AIIB 1 3/4 06/26/30	1'000	0	0	1'000 CHF	102.65%	1'026'500.00	0.22	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	750	0	0	750 CHF	103.00%	772'500.00	0.16	a)
XS							7'522'000.00	1.60	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	4'237'850.40	0.90
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	461'604'594.50	98.26
Sonstige Vermögenswerte	3'931'205.71	0.84
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	469'773'650.61	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-15'287.80	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	469'758'362.81	

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);	461'604'594.50	98.26
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 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.