

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB CHF

Halbjahresbericht per 31.07.2023

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Index Fund II
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
ASTT CHF	38329244	CHF
BVG 3 Index 45	38329242	CHF
DT CHF	38329248	CHF
FA CHF	21580464	CHF
GT CHF	38329251	CHF
NT CHF	21580466	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	29
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	30
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	30
7	Pauschale Verwaltungskommission	31
8	Benchmark	32
9	TER	32
10	Fussnoten	32
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	33

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 Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.07.2023	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'169'518'741.31	5'454'152'733.48	5'622'350'312.07	6'041'491'635.85
Klasse ASTT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		241'551'613.05	235'934'459.58	245'458'482.86	257'417'172.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'571'596.508	2'548'189.921	2'419'872.612	2'462'084.733
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.9306	92.5890	101.4345	104.5525
Thesaurierung je Anteil		-	0.60	0.62	0.84
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse BVG 3 Index 45	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		138'904'177.75	140'264'593.83	162'380'783.02	152'378'410.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'526'594.818	1'559'410.758	1'638'373.643	1'483'038.745
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.9896	89.9472	99.1110	102.7474
Thesaurierung je Anteil		-	0.06	0.03	0.25
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.72 %	0.72 %	0.71 %	0.70 %
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		47'703'151.42	25'225'891.31	14'058'886.63	30'872'740.79
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		515'437.435	275'887.351	140'025.389	297'469.417
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.5489	91.4355	100.4024	103.7846
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		96.8344	91.6365	96.1978	96.0276
Thesaurierung je Anteil		-	0.60	0.62	0.83
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse FA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		138'644'480.42	113'176'002.02	128'521'779.61	144'966'557.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'627'740.567	1'330'418.705	1'378'513.686	1'495'327.578
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.1760	85.0680	93.2321	96.9464
Ausschüttung je Anteil		-	1.10	-	0.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse GT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		379'927'393.00	250'470'774.31	257'619'258.85	890'562'688.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'100'750.925	2'736'497.050	2'563'702.261	8'575'208.423
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.6482	91.5297	100.4872	103.8532
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		96.9384	91.7309	96.2791	96.0910
Thesaurierung je Anteil		-	0.62	0.65	0.86
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.11 %	0.11 %	0.11 %	0.11 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'222'787'925.67	4'689'081'012.43	4'814'311'121.10	4'565'294'065.72
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		56'718'840.892	51'553'331.640	48'244'762.899	44'299'057.813
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.0821	90.9559	99.7893	103.0562
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		96.3460	91.1559	95.6104	95.3537
Thesaurierung je Anteil		-	0.72	0.76	0.97
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	YTD / 31.07.2023	2022	2021	2020
Klasse ASTT CHF	3.73 %	-11.98 %	-1.92 %	0.88 %
Klasse BVG 3 Index 45	3.38 %	-12.49 %	-2.47 %	0.31 %
Klasse DA CHF (Schliessung 14.07.2020)	-	-	-	-0.49 %
Klasse DT CHF	3.73 %	-11.98 %	-1.92 %	0.88 %
Klasse FA CHF	3.71 %	-12.02 %	-1.96 %	0.84 %
Klasse GT CHF	3.75 %	-11.95 %	-1.89 %	0.91 %
Klasse NT CHF	3.81 %	-11.86 %	-1.78 %	1.02 %
Benchmark	3.77 %	-12.10 %	-1.82 %	0.90 %
Tracking Error 33)	-	0.14 %	0.04 %	0.11 %

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 ASTT CHF	-0.04 %
Klasse BVG 3 Index 45	-0.39 %
Klasse DT CHF	-0.04 %
Klasse FA CHF	-0.06 %
Klasse GT CHF	-0.02 %
Klasse NT CHF	0.04 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.07.2023	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	24'017'116.01	24'918'506.28
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'724'253'499.52	4'197'566'608.93
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'390'348'133.65	1'204'408'944.44
Sonstige Vermögenswerte	31'078'213.52	27'424'232.83
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'169'696'962.70	5'454'318'292.48
Andere Verbindlichkeiten	-178'221.39	-165'559.00
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'169'518'741.31	5'454'152'733.48

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Klasse ASTT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'548'189.921	2'419'872.612
Ausgegebene Anteile		31'851.922	128'317.309
Zurückgenommene Anteile		-8'445.335	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'571'596.508	2'548'189.921
Klasse BVG 3 Index 45			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'559'410.758	1'638'373.643
Ausgegebene Anteile		15'251.723	89'335.694
Zurückgenommene Anteile		-48'067.663	-168'298.579
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'526'594.818	1'559'410.758
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		275'887.351	140'025.389
Ausgegebene Anteile		261'146.685	163'203.561
Zurückgenommene Anteile		-21'596.601	-27'341.599
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		515'437.435	275'887.351
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'330'418.705	1'378'513.686
Ausgegebene Anteile		424'765.104	457'503.171
Zurückgenommene Anteile		-127'443.242	-505'598.152
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'627'740.567	1'330'418.705
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'736'497.050	2'563'702.261
Ausgegebene Anteile		1'520'154.348	927'024.505
Zurückgenommene Anteile		-155'900.473	-754'229.716
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'100'750.925	2'736'497.050
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		51'553'331.640	48'244'762.899
Ausgegebene Anteile		6'503'162.310	5'417'859.478
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		1'419'480.917	1'712'797.253
Zurückgenommene Anteile		-1'959'590.731	-3'156'287.461
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-797'543.244	-665'800.529
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		56'718'840.892	51'553'331.640

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	26.04.2023	123'523'428.57	1'358'886.129
Klasse NT CHF	30.05.2023	5'538'999.87	60'594.788

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	24.02.2023	71'807'763.03	797'543.244

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		5'454'152'733.48	5'622'350'312.07
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'681'408.92	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-15'248'415.08	-13'927'770.67
Saldo aus dem Anteilverkehr		640'082'481.39	337'431'930.99
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		92'213'350.44	-491'701'738.91
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'169'518'741.31	5'454'152'733.48

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		18'982.39	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-140'590.52
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		22'419'245.32	36'441'719.77
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		10'608'365.75	5'622'940.39
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'679'291.34	3'576'263.57
Total Ertrag		34'725'884.80	45'500'333.21
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-964'150.26	-1'902'904.43
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-603'385.45	-1'979'107.07
Total Aufwand		-1'567'535.71	-3'882'011.50
Nettoertrag / Verlust		33'158'349.09	41'618'321.71
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-28'225'054.45	-64'456'425.78
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		2'839'674.86	2'312'803.67
Realisierter Erfolg		7'772'969.50	-20'525'300.40
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		84'440'380.94	-471'176'438.51
Gesamterfolg		92'213'350.44	-491'701'738.91

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							4'724'253'499.52	76.57	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							4'724'253'499.52	76.57	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	64'934	7'000	2'015	69'919 CHF	113.48%	79'344'081.20	1.29	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	30'820	4'000	0	34'820 CHF	167.57%	58'347'874.00	0.95	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	42'138	18'000	1'700	58'438 CHF	123.05%	71'907'959.00	1.17	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	4'840	1'000	0	5'840 CHF	107.00%	6'248'800.00	0.10	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	4'050	2'500	0	6'550 CHF	101.45%	6'644'975.00	0.11	a)
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	11'250	2'900	0	14'150 CHF	107.55%	15'218'325.00	0.25	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	3'590	1'000	0	4'590 CHF	101.60%	4'663'440.00	0.08	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	8'725	500	0	9'225 CHF	101.40%	9'354'150.00	0.15	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	10'240	0	0	10'240 CHF	101.80%	10'424'320.00	0.17	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'180	0	0	2'180 CHF	101.40%	2'210'520.00	0.04	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	6'990	1'000	0	7'990 CHF	104.15%	8'321'585.00	0.13	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	6'040	0	0	6'040 CHF	109.85%	6'634'940.00	0.11	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	2'700	0	0	2'700 CHF	101.75%	2'747'250.00	0.04	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	45'742	8'200	0	53'942 CHF	117.71%	63'495'128.20	1.03	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	8'980	2'500	0	11'480 CHF	103.35%	11'864'580.00	0.19	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'040	0	0	2'040 CHF	102.70%	2'095'080.00	0.03	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	2'110	0	0	2'110 CHF	111.85%	2'360'035.00	0.04	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	4'310	0	0	4'310 CHF	117.40%	5'059'940.00	0.08	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	2'400	1'000	0	3'400 CHF	101.90%	3'464'600.00	0.06	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	980	0	0	980 CHF	117.15%	1'148'070.00	0.02	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	2'440	0	0	2'440 CHF	108.65%	2'651'060.00	0.04	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN	4'300	0	0	4'300 CHF	111.20%	4'781'600.00	0.08	a)
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	1'510	0	0	1'510 CHF	108.95%	1'645'145.00	0.03	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	5'650	0	0	5'650 CHF	109.25%	6'172'625.00	0.10	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	6'050	2'000	0	8'050 CHF	101.03%	8'132'915.00	0.13	a)
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'420	0	0	1'420 CHF	113.55%	1'612'410.00	0.03	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	8'640	0	2'000	6'640 CHF	100.98%	6'705'072.00	0.11	a)
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	2'855	500	0	3'355 CHF	105.28%	3'532'144.00	0.06	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	1'740	0	0	1'740 CHF	101.06%	1'758'444.00	0.03	a)
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	470	0	0	470 CHF	118.30%	556'010.00	0.01	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	35'778	2'500	0	38'278 CHF	108.25%	41'435'935.00	0.67	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	3'120	0	0	3'120 CHF	107.05%	3'339'960.00	0.05	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	4'200	0	0	4'200 CHF	101.55%	4'265'100.00	0.07	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	2'550	0	0	2'550 CHF	101.15%	2'579'325.00	0.04	a)
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	1'690	1'000	0	2'690 CHF	101.15%	2'720'935.00	0.04	a)
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	2'300	500	0	2'800 CHF	107.20%	3'001'600.00	0.05	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	2'475	500	0	2'975 CHF	105.25%	3'131'187.50	0.05	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	1'745	0	0	1'745 CHF	100.00%	1'745'000.00	0.03	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	1'800	1'600	0	3'400 CHF	102.25%	3'476'500.00	0.06	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	7'855	0	0	7'855 CHF	103.85%	8'157'417.50	0.13	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	3'820	0	0	3'820 CHF	100.20%	3'827'640.00	0.06	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	1'270	0	0	1'270 CHF	100.30%	1'273'810.00	0.02	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	9'305	2'200	0	11'505 CHF	100.95%	11'614'297.50	0.19	a)
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	1'370	0	0	1'370 CHF	102.80%	1'408'360.00	0.02	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	900	0	0	900 CHF	99.80%	898'200.00	0.01	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	100.70%	1'711'900.00	0.03	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	850	0	0	850 CHF	102.70%	872'950.00	0.01	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	1'520	0	0	1'520 CHF	100.40%	1'526'080.00	0.02	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	6'665	0	0	6'665 CHF	100.28%	6'683'662.00	0.11	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	225	0	0	225 CHF	100.85%	226'912.50	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	930	0	0	930 CHF	104.00%	967'200.00	0.02	a)
CH0119542634	2.0000 % EIB 2 11/30/35	750	0	10	740 CHF	104.30%	771'820.00	0.01	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'740	0	0	2'740 CHF	101.50%	2'781'100.00	0.05	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	2'615	0	0	2'615 CHF	101.85%	2'663'377.50	0.04	a)
CH0119983077	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 11/26/35	1'000	1'000	0	2'000 CHF	99.70%	1'994'000.00	0.03	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	8'115	0	0	8'115 CHF	101.70%	8'252'955.00	0.13	a)
CH0120381592	2.0000 % KBLUZE 2 12/06/33	900	0	0	900 CHF	100.95%	908'550.00	0.01	a)
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	1'480	0	0	1'480 CHF	101.25%	1'498'500.00	0.02	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	4'490	0	4'490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	3'910	0	0	3'910 CHF	102.27%	3'998'757.00	0.06	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	4'790	5'285	0	10'075 CHF	106.10%	10'689'575.00	0.17	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'720	0	0	1'720 CHF	101.65%	1'748'380.00	0.03	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	105.45%	3'321'675.00	0.05	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	1'580	0	0	1'580 CHF	108.80%	1'719'040.00	0.03	a)
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	2'310	0	0	2'310 CHF	109.40%	2'527'140.00	0.04	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	2'650	0	0	2'650 CHF	101.55%	2'691'075.00	0.04	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	10'470	2'000	0	12'470 CHF	101.66%	12'677'002.00	0.21	a)
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	100	0	0	100 CHF	109.55%	109'550.00	0.00	a)
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	935	0	0	935 CHF	111.75%	1'044'862.50	0.02	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	4'520	0	0	4'520 CHF	101.35%	4'581'020.00	0.07	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	36'802	5'500	0	42'302 CHF	109.58%	46'354'531.60	0.75	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	47'057	7'200	0	54'257 CHF	108.51%	58'874'270.70	0.95	a)
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	38'199	1'500	36'400	3'299 CHF	99.79%	3'292'072.10	0.05	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	47'624	4'650	1'200	51'074 CHF	103.01%	52'611'327.40	0.85	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	3'375	1'400	0	4'775 CHF	101.31%	4'837'552.50	0.08	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	1'330	0	0	1'330 CHF	105.50%	1'403'150.00	0.02	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	1'420	0	0	1'420 CHF	106.30%	1'509'460.00	0.02	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	3'560	2'000	0	5'560 CHF	102.96%	5'724'576.00	0.09	a)
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	3'040	0	0	3'040 CHF	112.80%	3'429'120.00	0.06	a)
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	1'070	0	0	1'070 CHF	104.35%	1'116'545.00	0.02	a)
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	400	0	0	400 CHF	102.65%	410'600.00	0.01	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	3'200	0	0	3'200 CHF	100.95%	3'230'400.00	0.05	a)
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	2'000	0	0	2'000 CHF	100.20%	2'004'000.00	0.03	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	3'410	4'000	0	7'410 CHF	99.69%	7'387'029.00	0.12	a)
CH0138276859	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 10/04/41	1'000	250	0	1'250 CHF	103.30%	1'291'250.00	0.02	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	2'140	0	0	2'140 CHF	99.75%	2'134'650.00	0.03	a)
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	3'360	0	0	3'360 CHF	99.63%	3'347'568.00	0.05	a)
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'120	0	0	1'120 CHF	99.50%	1'114'400.00	0.02	a)
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	8'100	0	1'000	7'100 CHF	99.71%	7'079'410.00	0.11	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	1'480	1'200	0	2'680 CHF	99.84%	2'675'712.00	0.04	a)
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	4'310	0	4'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	2'280	0	0	2'280 CHF	99.10%	2'259'480.00	0.04	a)
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	1'530	0	0	1'530 CHF	104.70%	1'601'910.00	0.03	a)
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	4'580	0	0	4'580 CHF	97.37%	4'459'546.00	0.07	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	3'300	0	0	3'300 CHF	98.55%	3'252'150.00	0.05	a)
CH0143808365	1.5000 % BVZNSW 1 1/2 04/12/32	0	1'200	0	1'200 CHF	99.35%	1'192'200.00	0.02	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	7'170	0	0	7'170 CHF	98.70%	7'076'790.00	0.11	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	3'040	0	3'040	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	6'050	0	6'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	4'550	0	0	4'550 CHF	95.79%	4'358'445.00	0.07	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	3'060	500	0	3'560 CHF	98.95%	3'522'620.00	0.06	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'790	0	0	1'790 CHF	98.60%	1'764'940.00	0.03	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 CHF	100.00%	5'000'000.00	0.08	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	9'200	2'000	0	11'200 CHF	98.40%	11'020'800.00	0.18	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	1'500	0	0	1'500 CHF	98.50%	1'477'500.00	0.02	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'850	0	0	1'850 CHF	98.40%	1'820'400.00	0.03	a)
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	1'380	0	0	1'380 CHF	101.00%	1'393'800.00	0.02	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	1'355	0	0	1'355 CHF	99.05%	1'342'127.50	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	5'600	0	0	5'600 CHF	99.29%	5'560'240.00	0.09	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	6'410	1'000	0	7'410 CHF	98.85%	7'324'785.00	0.12	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	39'520	7'000	0	46'520 CHF	100.64%	46'817'728.00	0.76	a)
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	920	0	0	920 CHF	95.60%	879'520.00	0.01	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	3'075	0	0	3'075 CHF	99.20%	3'050'400.00	0.05	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	8'320	700	0	9'020 CHF	98.60%	8'893'720.00	0.14	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	1'240	250	0	1'490 CHF	98.00%	1'460'200.00	0.02	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	1'000	0	0	1'000 CHF	94.00%	940'000.00	0.02	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'030	600	0	1'630 CHF	98.40%	1'603'920.00	0.03	a)
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'085	750	0	2'835 CHF	98.80%	2'800'980.00	0.05	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	2'080	0	2'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.41%	994'100.00	0.02	a)
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	2'070	0	0	2'070 CHF	97.90%	2'026'530.00	0.03	a)
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	6'470	0	0	6'470 CHF	99.86%	6'460'942.00	0.10	a)
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	4'300	0	0	4'300 CHF	99.40%	4'274'200.00	0.07	a)
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	2'900	0	0	2'900 CHF	96.85%	2'808'650.00	0.05	a)
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	2'200	1'000	0	3'200 CHF	98.90%	3'164'800.00	0.05	a)
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	99.46%	2'486'500.00	0.04	a)
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	7'270	0	0	7'270 CHF	97.70%	7'102'790.00	0.12	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	4'825	0	0	4'825 CHF	98.34%	4'744'905.00	0.08	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	2'970	0	0	2'970 CHF	98.15%	2'915'055.00	0.05	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	11'200	500	0	11'700 CHF	97.88%	11'451'960.00	0.19	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	440	0	0	440 CHF	99.08%	435'952.00	0.01	a)
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	2'000	500	0	2'500 CHF	98.45%	2'461'250.00	0.04	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	2'020	0	0	2'020 CHF	94.65%	1'911'930.00	0.03	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'420	0	0	1'420 CHF	97.15%	1'379'530.00	0.02	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	2'270	1'000	0	3'270 CHF	98.50%	3'220'950.00	0.05	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	3'000	0	0	3'000 CHF	97.80%	2'934'000.00	0.05	a)
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	3'680	0	3'680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	3'950	0	0	3'950 CHF	98.30%	3'882'850.00	0.06	a)
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	2'210	0	2'210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	2'160	0	2'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	2'240	0	0	2'240 CHF	97.00%	2'172'800.00	0.04	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	1'860	0	0	1'860 CHF	98.30%	1'828'380.00	0.03	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	6'550	0	0	6'550 CHF	98.19%	6'431'445.00	0.10	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	1'250	0	0	1'250 CHF	97.15%	1'214'375.00	0.02	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	4'260	0	0	4'260 CHF	99.00%	4'217'400.00	0.07	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	2'700	0	0	2'700 CHF	99.20%	2'678'400.00	0.04	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	1'240	0	0	1'240 CHF	96.50%	1'196'600.00	0.02	a)
CH0206594506	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 10/16/23	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	2'300	0	0	2'300 CHF	99.45%	2'287'350.00	0.04	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	3'320	500	0	3'820 CHF	99.20%	3'789'440.00	0.06	a)
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	1'255	0	0	1'255 CHF	98.55%	1'236'802.50	0.02	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'320	1'000	0	2'320 CHF	102.60%	2'380'320.00	0.04	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	400	0	0	400 CHF	98.70%	394'800.00	0.01	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	2'050	0	0	2'050 CHF	101.00%	2'070'500.00	0.03	a)
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	1'170	1'800	0	2'970 CHF	96.70%	2'871'990.00	0.05	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'550	0	0	1'550 CHF	98.60%	1'528'300.00	0.02	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	3'300	0	0	3'300 CHF	99.13%	3'271'290.00	0.05	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	12'125	0	0	12'125 CHF	99.20%	12'028'000.00	0.19	a)
CH0212114653	1.8000 % TESSIN 1.8 05/15/43	1'110	0	0	1'110 CHF	102.35%	1'136'085.00	0.02	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	1'870	0	0	1'870 CHF	100.90%	1'886'830.00	0.03	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	1'570	0	0	1'570 CHF	99.70%	1'565'290.00	0.03	a)
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	1'080	0	0	1'080 CHF	96.90%	1'046'520.00	0.02	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	2'580	0	0	2'580 CHF	99.60%	2'569'680.00	0.04	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	1'670	800	0	2'470 CHF	100.70%	2'487'290.00	0.04	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	4'000	500	0	4'500 CHF	98.71%	4'441'950.00	0.07	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'610	0	0	1'610 CHF	101.80%	1'638'980.00	0.03	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	840	700	0	1'540 CHF	100.60%	1'549'240.00	0.03	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	6'700	0	0	6'700 CHF	99.80%	6'686'600.00	0.11	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	930	2'100	0	3'030 CHF	100.90%	3'057'270.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	1'340	0	0	1'340 CHF	104.50%	1'400'300.00	0.02	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'040	1'500	0	2'540 CHF	99.95%	2'538'730.00	0.04	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	3'380	0	0	3'380 CHF	105.55%	3'567'590.00	0.06	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	4'550	0	0	4'550 CHF	99.70%	4'536'350.00	0.07	a)
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	2'740	0	0	2'740 CHF	99.77%	2'733'698.00	0.04	a)
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'000	0	0	1'000 CHF	104.15%	1'041'500.00	0.02	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	2'940	0	0	2'940 CHF	100.60%	2'957'640.00	0.05	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	3'710	0	0	3'710 CHF	103.50%	3'839'850.00	0.06	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	2'920	0	0	2'920 CHF	99.69%	2'910'948.00	0.05	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	38'160	9'450	0	47'610 CHF	100.37%	47'786'157.00	0.77	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	39'280	2'700	0	41'980 CHF	141.51%	59'405'898.00	0.96	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	41'277	2'500	0	43'777 CHF	96.71%	42'336'736.70	0.69	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	21'230	1'500	0	22'730 CHF	87.71%	19'936'483.00	0.32	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	43'260	18'400	0	61'660 CHF	94.24%	58'108'384.00	0.94	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	5'680	0	0	5'680 CHF	103.85%	5'898'680.00	0.10	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	600	0	0	600 CHF	103.70%	622'200.00	0.01	a)
CH0224761517	1.8750 % SIKASW 1 7/8 11/14/23	1'705	0	1'705	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224761533	1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23	1'960	0	1'960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	1'090	0	0	1'090 CHF	99.45%	1'084'005.00	0.02	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	2'790	0	2'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	970	0	970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227694574	1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	1'200	0	0	1'200 CHF	99.54%	1'194'480.00	0.02	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	250	0	0	250 CHF	106.35%	265'875.00	0.00	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	1'850	0	0	1'850 CHF	103.45%	1'913'825.00	0.03	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	1'600	1'500	0	3'100 CHF	107.25%	3'324'750.00	0.05	a)
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	830	0	0	830 CHF	106.70%	885'610.00	0.01	a)
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	3'350	0	3'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	2'940	0	0	2'940 CHF	99.95%	2'938'530.00	0.05	a)
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	3'190	0	3'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	6'330	4'000	0	10'330 CHF	99.35%	10'262'855.00	0.17	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	400	0	0	400 CHF	100.70%	402'800.00	0.01	a)
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	2'095	0	0	2'095 CHF	106.40%	2'229'080.00	0.04	a)
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	99.98%	1'899'620.00	0.03	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	2'210	0	0	2'210 CHF	99.25%	2'193'425.00	0.04	a)
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	7'720	0	0	7'720 CHF	99.34%	7'669'048.00	0.12	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	2'820	0	2'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	3'820	4'000	0	7'820 CHF	99.18%	7'755'876.00	0.13	a)
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	2'940	1'500	800	3'640 CHF	99.32%	3'615'248.00	0.06	a)
CH0244175201	1.2500 % KBRFRB 1 1/4 06/03/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.37%	993'700.00	0.02	a)
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	750	0	0	750 CHF	98.65%	739'875.00	0.01	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	6'900	0	0	6'900 CHF	98.59%	6'802'710.00	0.11	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	2'100	1'600	0	3'700 CHF	99.80%	3'692'600.00	0.06	a)
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	99.15%	2'181'300.00	0.04	a)
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	2'990	0	2'990	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	5'210	0	0	5'210 CHF	99.33%	5'175'093.00	0.08	a)
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	2'480	0	0	2'480 CHF	97.85%	2'426'680.00	0.04	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	97.10%	971'000.00	0.02	a)
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	98.84%	1'482'600.00	0.02	a)
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'845	0	0	1'845 CHF	97.70%	1'802'565.00	0.03	a)
CH0252511925	0.8750 % LANSBK 0 7/8 09/16/24 EMTN	1'570	0	0	1'570 CHF	98.79%	1'551'003.00	0.03	a)
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'170	250	0	2'420 CHF	97.85%	2'367'970.00	0.04	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	4'150	0	0	4'150 CHF	97.45%	4'044'175.00	0.07	a)
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	1'000	0	0	1'000 CHF	98.85%	988'500.00	0.02	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'800	0	0	1'800 CHF	97.25%	1'750'500.00	0.03	a)
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	98.00%	2'744'000.00	0.04	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	7'450	0	7'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'600	0	0	1'600 CHF	97.40%	1'558'400.00	0.03	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	1'320	0	0	1'320 CHF	97.30%	1'284'360.00	0.02	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	5'030	0	800	4'230 CHF	97.85%	4'139'055.00	0.07	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	6'450	0	0	6'450 CHF	97.61%	6'295'845.00	0.10	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	4'750	0	0	4'750 CHF	96.50%	4'583'750.00	0.07	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	94.95%	1'756'575.00	0.03	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	7'080	0	0	7'080 CHF	98.75%	6'991'500.00	0.11	a)
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	700	0	0	700 CHF	98.63%	690'410.00	0.01	a)
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	3'450	0	0	3'450 CHF	98.58%	3'401'010.00	0.06	a)
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	7'260	0	0	7'260 CHF	98.82%	7'174'332.00	0.12	a)
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	2'570	1'000	0	3'570 CHF	97.15%	3'468'255.00	0.06	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	4'060	1'000	0	5'060 CHF	97.05%	4'910'730.00	0.08	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	2'250	1'000	0	3'250 CHF	95.65%	3'108'625.00	0.05	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	760	0	0	760 CHF	98.48%	748'448.00	0.01	a)
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	1'720	0	0	1'720 CHF	98.62%	1'696'264.00	0.03	a)
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	3'040	0	0	3'040 CHF	98.35%	2'989'840.00	0.05	a)
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	2'395	2'500	0	4'895 CHF	96.20%	4'708'990.00	0.08	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	4'150	0	0	4'150 CHF	93.85%	3'894'775.00	0.06	a)
CH0262286252	0.6250 % WKBNSW 0 5/8 12/15/23	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	7'620	0	7'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	9'810	5'600	0	15'410 CHF	96.14%	14'815'174.00	0.24	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	11'950	0	0	11'950 CHF	98.00%	11'711'000.00	0.19	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	6'580	0	1'400	5'180 CHF	97.80%	5'066'040.00	0.08	a)
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	2'330	0	0	2'330 CHF	92.35%	2'151'755.00	0.03	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	1'400	0	0	1'400 CHF	97.35%	1'362'900.00	0.02	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	98.27%	2'702'425.00	0.04	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	7'720	1'140	0	8'860 CHF	91.55%	8'111'330.00	0.13	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	3'030	0	0	3'030 CHF	96.20%	2'914'860.00	0.05	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	1'100	0	0	1'100 CHF	88.70%	975'700.00	0.02	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	1'350	0	0	1'350 CHF	97.40%	1'314'900.00	0.02	a)
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	1'990	0	0	1'990 CHF	87.85%	1'748'215.00	0.03	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	6'450	2'500	0	8'950 CHF	92.95%	8'319'025.00	0.13	a)
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	2'380	0	0	2'380 CHF	94.80%	2'256'240.00	0.04	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	940	0	0	940 CHF	94.30%	886'420.00	0.01	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	1'820	0	0	1'820 CHF	92.40%	1'681'680.00	0.03	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	2'360	0	0	2'360 CHF	94.05%	2'219'580.00	0.04	a)
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'910	0	0	1'910 CHF	87.85%	1'677'935.00	0.03	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'560	1'990	0	3'550 CHF	95.60%	3'393'800.00	0.06	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	1'130	0	0	1'130 CHF	92.80%	1'048'640.00	0.02	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	7'610	0	0	7'610 CHF	94.18%	7'167'098.00	0.12	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	7'000	1'000	0	8'000 CHF	90.75%	7'260'000.00	0.12	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	1'150	0	0	1'150 CHF	97.90%	1'125'850.00	0.02	a)
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	910	0	0	910 CHF	95.20%	866'320.00	0.01	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'120	0	0	1'120 CHF	89.55%	1'002'960.00	0.02	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	10'220	0	0	10'220 CHF	97.90%	10'005'380.00	0.16	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	7'280	2'000	0	9'280 CHF	93.70%	8'695'360.00	0.14	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRIB 0.6 04/09/27	1'200	500	0	1'700 CHF	95.10%	1'616'700.00	0.03	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	6'900	0	1'000	5'900 CHF	95.05%	5'607'950.00	0.09	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	0	1'550	0	1'550 CHF	98.35%	1'524'425.00	0.02	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'250	500	0	2'750 CHF	97.40%	2'678'500.00	0.04	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'400	0	0	1'400 CHF	95.00%	1'330'000.00	0.02	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'720	0	0	2'720 CHF	93.20%	2'535'040.00	0.04	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	0	2'300	0	2'300 CHF	97.00%	2'231'000.00	0.04	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	7'340	0	0	7'340 CHF	90.05%	6'609'670.00	0.11	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'530	0	0	1'530 CHF	97.00%	1'484'100.00	0.02	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	7'680	0	7'680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	5'520	3'100	0	8'620 CHF	92.15%	7'943'330.00	0.13	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'920	0	0	1'920 CHF	97.10%	1'864'320.00	0.03	a)
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	3'820	0	1'000	2'820 CHF	89.50%	2'523'900.00	0.04	a)
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	4'770	0	4'770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	11'250	0	1'700	9'550 CHF	89.30%	8'528'150.00	0.14	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	2'140	1'000	0	3'140 CHF	97.10%	3'048'940.00	0.05	a)
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	930	0	0	930 CHF	92.10%	856'530.00	0.01	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	1'485	0	0	1'485 CHF	97.60%	1'449'360.00	0.02	a)
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	2'100	0	0	2'100 CHF	98.71%	2'072'910.00	0.03	a)
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	4'380	0	0	4'380 CHF	89.35%	3'913'530.00	0.06	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	4'930	0	0	4'930 CHF	86.62%	4'270'366.00	0.07	a)
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	4'330	0	0	4'330 CHF	98.73%	4'275'009.00	0.07	a)
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	1'590	0	0	1'590 CHF	93.50%	1'486'650.00	0.02	a)
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	1'050	0	0	1'050 CHF	98.69%	1'036'245.00	0.02	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	4'050	500	0	4'550 CHF	97.25%	4'424'875.00	0.07	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	11'100	2'000	0	13'100 CHF	97.98%	12'835'380.00	0.21	a)
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	8'825	0	0	8'825 CHF	93.95%	8'291'087.50	0.13	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	5'280	0	0	5'280 CHF	90.28%	4'766'784.00	0.08	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	800	1'000	0	1'800 CHF	97.50%	1'755'000.00	0.03	a)
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	590	0	0	590 CHF	92.65%	546'635.00	0.01	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	2'190	0	0	2'190 CHF	96.05%	2'103'495.00	0.03	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	6'880	1'500	0	8'380 CHF	95.54%	8'006'252.00	0.13	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	2'125	0	0	2'125 CHF	97.55%	2'072'937.50	0.03	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	7'750	2'000	0	9'750 CHF	97.34%	9'490'650.00	0.15	a)
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.02	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	5'700	2'000	0	7'700 CHF	96.47%	7'428'190.00	0.12	a)
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	300	0	0	300 CHF	90.70%	272'100.00	0.00	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	99.25%	1'687'250.00	0.03	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	10'500	0	0	10'500 CHF	91.90%	9'649'500.00	0.16	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	2'550	0	0	2'550 CHF	96.70%	2'465'850.00	0.04	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	7'120	0	0	7'120 CHF	96.89%	6'898'568.00	0.11	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	6'540	0	0	6'540 CHF	96.81%	6'331'374.00	0.10	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	6'150	500	0	6'650 CHF	91.55%	6'088'075.00	0.10	a)
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	2'430	0	0	2'430 CHF	92.40%	2'245'320.00	0.04	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	2'620	0	0	2'620 CHF	92.30%	2'418'260.00	0.04	a)
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	1'110	0	0	1'110 CHF	97.75%	1'085'025.00	0.02	a)
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	6'840	0	0	6'840 CHF	98.35%	6'727'140.00	0.11	a)
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	6'750	1'500	0	8'250 CHF	92.24%	7'609'800.00	0.12	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	96.35%	2'408'750.00	0.04	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	5'650	4'000	0	9'650 CHF	92.92%	8'966'780.00	0.15	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	3'230	0	0	3'230 CHF	97.80%	3'158'940.00	0.05	a)
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	2'745	500	0	3'245 CHF	92.20%	2'991'890.00	0.05	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	2'540	500	0	3'040 CHF	94.30%	2'866'720.00	0.05	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	6'220	1'500	0	7'720 CHF	89.70%	6'924'840.00	0.11	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	95.20%	1'904'000.00	0.03	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	4'000	1'500	0	5'500 CHF	95.65%	5'260'750.00	0.09	a)
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	5'160	0	5'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	2'800	0	0	2'800 CHF	96.30%	2'696'400.00	0.04	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	800	0	0	800 CHF	93.75%	750'000.00	0.01	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	1'900	0	0	1'900 CHF	91.85%	1'745'150.00	0.03	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	7'080	0	0	7'080 CHF	95.68%	6'774'144.00	0.11	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	9'390	2'500	0	11'890 CHF	91.75%	10'909'075.00	0.18	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	0	500	0	500 CHF	97.90%	489'500.00	0.01	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	8'740	0	1'200	7'540 CHF	93.27%	7'032'558.00	0.11	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	8'190	2'000	0	10'190 CHF	87.26%	8'891'794.00	0.14	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	9'390	750	0	10'140 CHF	95.38%	9'671'532.00	0.16	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	95.45%	2'290'800.00	0.04	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	6'280	1'500	2'000	5'780 CHF	93.60%	5'410'080.00	0.09	a)
CH0311427618	0.2000 % WKBNSW 0.2 08/19/24	500	0	0	500 CHF	98.09%	490'450.00	0.01	a)
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	2'550	250	0	2'800 CHF	92.75%	2'597'000.00	0.04	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	3'050	2'000	0	5'050 CHF	97.60%	4'928'800.00	0.08	a)
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	5'620	1'500	0	7'120 CHF	87.75%	6'247'800.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	2'360	0	0	2'360 CHF	85.45%	2'016'620.00	0.03	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'720	0	0	1'720 CHF	96.35%	1'657'220.00	0.03	a)
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	4'270	0	0	4'270 CHF	85.70%	3'659'390.00	0.06	a)
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	350	0	0	350 CHF	97.98%	342'930.00	0.01	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	10'820	0	0	10'820 CHF	94.37%	10'210'834.00	0.17	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	1'350	3'500	0	4'850 CHF	95.25%	4'619'625.00	0.07	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	650	0	0	650 CHF	95.30%	619'450.00	0.01	a)
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	10'440	400	0	10'840 CHF	89.29%	9'679'036.00	0.16	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	10'260	0	0	10'260 CHF	91.95%	9'434'070.00	0.15	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	7'270	1'000	0	8'270 CHF	89.20%	7'376'840.00	0.12	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	9'210	0	0	9'210 CHF	86.35%	7'952'835.00	0.13	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	0	350	0	350 CHF	94.70%	331'450.00	0.01	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	2'210	0	0	2'210 CHF	86.30%	1'907'230.00	0.03	a)
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	700	0	0	700 CHF	88.70%	620'900.00	0.01	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	9'575	0	1'000	8'575 CHF	98.73%	8'466'097.50	0.14	a)
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	5'350	0	0	5'350 CHF	94.20%	5'039'700.00	0.08	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	7'310	0	0	7'310 CHF	93.01%	6'799'031.00	0.11	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'550	0	0	1'550 CHF	94.35%	1'462'425.00	0.02	a)
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	5'640	0	0	5'640 CHF	79.85%	4'503'540.00	0.07	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	2'000	0	0	2'000 CHF	96.20%	1'924'000.00	0.03	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'155	0	0	1'155 CHF	92.30%	1'066'065.00	0.02	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	7'410	0	0	7'410 CHF	80.52%	5'966'532.00	0.10	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	4'050	0	0	4'050 CHF	96.50%	3'908'250.00	0.06	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'030	500	0	2'530 CHF	78.25%	1'979'725.00	0.03	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'150	0	0	2'150 CHF	92.75%	1'994'125.00	0.03	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	5'790	2'300	0	8'090 CHF	80.55%	6'516'495.00	0.11	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	2'060	0	0	2'060 CHF	96.35%	1'984'810.00	0.03	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	350	0	0	350 CHF	88.45%	309'575.00	0.01	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	800	0	0	800 CHF	95.00%	760'000.00	0.01	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	2'990	0	0	2'990 CHF	91.15%	2'725'385.00	0.04	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	5'330	0	0	5'330 CHF	88.05%	4'693'065.00	0.08	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	4'050	0	0	4'050 CHF	78.10%	3'163'050.00	0.05	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	5'660	800	0	6'460 CHF	74.68%	4'824'328.00	0.08	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	870	0	0	870 CHF	94.70%	823'890.00	0.01	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	1'530	0	0	1'530 CHF	97.73%	1'495'269.00	0.02	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	6'455	0	3'000	3'455 CHF	98.43%	3'400'756.50	0.06	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	10'710	0	0	10'710 CHF	93.94%	10'060'974.00	0.16	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	7'830	2'500	0	10'330 CHF	87.89%	9'079'037.00	0.15	a)
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	2'950	0	0	2'950 CHF	86.75%	2'559'125.00	0.04	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	8'650	0	0	8'650 CHF	94.55%	8'178'575.00	0.13	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	6'750	0	0	6'750 CHF	86.25%	5'821'875.00	0.09	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	7'790	0	0	7'790 CHF	77.53%	6'039'587.00	0.10	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	7'780	0	0	7'780 CHF	82.35%	6'406'830.00	0.10	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	5'260	0	1'500	3'760 CHF	90.90%	3'417'840.00	0.06	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	2'750	600	0	3'350 CHF	77.10%	2'582'850.00	0.04	a)
CH0341725858	0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN	0	7'030	0	7'030 CHF	98.00%	6'889'400.00	0.11	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	3'450	0	3'450 CHF	92.30%	3'184'350.00	0.05	a)
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	4'235	0	0	4'235 CHF	71.80%	3'040'730.00	0.05	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	1'590	2'000	0	3'590 CHF	94.10%	3'378'190.00	0.05	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	2'270	0	0	2'270 CHF	77.25%	1'753'575.00	0.03	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	3'500	0	0	3'500 CHF	88.00%	3'080'000.00	0.05	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	5'000	500	0	5'500 CHF	88.20%	4'851'000.00	0.08	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	10'960	0	0	10'960 CHF	97.10%	10'642'160.00	0.17	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	11'120	0	0	11'120 CHF	97.67%	10'860'904.00	0.18	a)
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	5'500	1'000	0	6'500 CHF	93.00%	6'045'000.00	0.10	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	900	0	0	900 CHF	90.80%	817'200.00	0.01	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	250	0	0	250 CHF	92.80%	232'000.00	0.00	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	1'650	0	0	1'650 CHF	94.15%	1'553'475.00	0.03	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	24'070	12'100	600	35'570 CHF	88.27%	31'397'639.00	0.51	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	37'070	3'500	0	40'570 CHF	90.74%	36'813'218.00	0.60	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	35'340	4'000	0	39'340 CHF	95.92%	37'734'928.00	0.61	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	700	0	0	700 CHF	97.12%	679'840.00	0.01	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	11'600	0	0	11'600 CHF	96.00%	11'136'000.00	0.18	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRI 0.3 02/17/27	3'260	0	0	3'260 CHF	94.30%	3'074'180.00	0.05	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	2'100	0	0	2'100 CHF	93.75%	1'968'750.00	0.03	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	3'650	250	0	3'900 CHF	92.20%	3'595'800.00	0.06	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	95.30%	1'810'700.00	0.03	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	9'360	0	0	9'360 CHF	96.99%	9'078'264.00	0.15	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	6'750	500	0	7'250 CHF	93.75%	6'796'875.00	0.11	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	7'715	1'000	0	8'715 CHF	86.70%	7'555'905.00	0.12	a)
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	2'800	0	0	2'800 CHF	89.85%	2'515'800.00	0.04	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBNSW 0.2 02/02/26	3'900	0	0	3'900 CHF	95.50%	3'724'500.00	0.06	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	11'850	1'500	0	13'350 CHF	94.40%	12'602'400.00	0.20	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	10'640	1'500	1'000	11'140 CHF	90.15%	10'042'710.00	0.16	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	2'150	0	0	2'150 CHF	93.30%	2'005'950.00	0.03	a)
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	3'600	1'000	0	4'600 CHF	92.35%	4'248'100.00	0.07	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'240	0	0	1'240 CHF	91.80%	1'138'320.00	0.02	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	5'990	0	0	5'990 CHF	94.00%	5'630'600.00	0.09	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	1'330	0	0	1'330 CHF	98.03%	1'303'799.00	0.02	a)
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	1'050	0	0	1'050 CHF	95.20%	999'600.00	0.02	a)
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	2'290	500	0	2'790 CHF	95.45%	2'663'055.00	0.04	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	6'220	0	6'220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	11'580	0	1'700	9'880 CHF	95.28%	9'413'664.00	0.15	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	14'510	0	0	14'510 CHF	92.56%	13'430'456.00	0.22	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	650	0	0	650 CHF	96.30%	625'950.00	0.01	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	800	0	0	800 CHF	86.20%	689'600.00	0.01	a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	0	3'000	0	3'000 CHF	98.41%	2'952'300.00	0.05	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	96.85%	2'711'800.00	0.04	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	10'780	1'500	0	12'280 CHF	94.75%	11'635'300.00	0.19	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	11'580	0	0	11'580 CHF	94.28%	10'917'624.00	0.18	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	4'450	0	0	4'450 CHF	93.15%	4'145'175.00	0.07	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	7'680	0	0	7'680 CHF	95.69%	7'348'992.00	0.12	a)
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'250	0	0	1'250 CHF	90.00%	1'125'000.00	0.02	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	4'330	1'500	0	5'830 CHF	96.33%	5'616'039.00	0.09	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'390	200	0	2'590 CHF	85.70%	2'219'630.00	0.04	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	1'670	150	0	1'820 CHF	86.60%	1'576'120.00	0.03	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	2'150	0	0	2'150 CHF	88.85%	1'910'275.00	0.03	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	1'370	0	0	1'370 CHF	94.10%	1'289'170.00	0.02	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	1'340	0	0	1'340 CHF	85.40%	1'144'360.00	0.02	a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	2'125	0	0	2'125 CHF	97.20%	2'065'500.00	0.03	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'900	0	0	1'900 CHF	93.05%	1'767'950.00	0.03	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	1'100	0	0	1'100 CHF	86.65%	953'150.00	0.02	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	6'740	0	6'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	5'150	0	0	5'150 CHF	88.40%	4'552'600.00	0.07	a)
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	3'360	0	0	3'360 CHF	85.20%	2'862'720.00	0.05	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	95.75%	4'787'500.00	0.08	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	0	3'090	0	3'090 CHF	97.50%	3'012'750.00	0.05	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	900	0	0	900 CHF	96.40%	867'600.00	0.01	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	4'600	0	0	4'600 CHF	92.05%	4'234'300.00	0.07	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'800	0	0	1'800 CHF	93.55%	1'683'900.00	0.03	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	1'700	0	0	1'700 CHF	92.05%	1'564'850.00	0.03	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	1'200	0	0	1'200 CHF	95.65%	1'147'800.00	0.02	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	0	1'740	0	1'740 CHF	92.95%	1'617'330.00	0.03	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	3'570	0	0	3'570 CHF	96.20%	3'434'340.00	0.06	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	1'450	0	0	1'450 CHF	98.58%	1'429'410.00	0.02	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	9'200	0	1'000	8'200 CHF	95.09%	7'797'380.00	0.13	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	2'800	0	0	2'800 CHF	83.70%	2'343'600.00	0.04	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	3'525	1'500	1'100	3'925 CHF	96.40%	3'783'700.00	0.06	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	10'650	1'500	0	12'150 CHF	93.31%	11'337'165.00	0.18	a)
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	900	0	0	900 CHF	86.75%	780'750.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	8'190	0	0	8'190 CHF	93.52%	7'659'288.00	0.12	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	2'330	0	0	2'330 CHF	89.05%	2'074'865.00	0.03	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'730	0	0	3'730 CHF	93.20%	3'476'360.00	0.06	a)
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	1'700	0	0	1'700 CHF	89.75%	1'525'750.00	0.02	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	11'830	0	700	11'130 CHF	94.09%	10'472'217.00	0.17	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	4'170	1'400	0	5'570 CHF	90.45%	5'038'065.00	0.08	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	3'000	0	0	3'000 CHF	95.95%	2'878'500.00	0.05	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	3'250	0	0	3'250 CHF	97.25%	3'160'625.00	0.05	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	9'700	1'000	0	10'700 CHF	93.60%	10'015'200.00	0.16	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	1'610	0	0	1'610 CHF	92.35%	1'486'835.00	0.02	a)
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	2'200	0	0	2'200 CHF	98.54%	2'167'880.00	0.04	a)
CH0373476784	0.5000 % KB5H 0 1/2 05/31/28	1'700	0	0	1'700 CHF	93.45%	1'588'650.00	0.03	a)
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	1'620	0	0	1'620 CHF	96.95%	1'570'590.00	0.03	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	2'660	2'800	0	5'460 CHF	91.00%	4'968'600.00	0.08	a)
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	0	2'075	0	2'075 CHF	96.55%	2'003'412.50	0.03	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'150	0	0	2'150 CHF	93.55%	2'011'325.00	0.03	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'060	0	0	2'060 CHF	95.55%	1'968'330.00	0.03	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	3'020	250	0	3'270 CHF	91.40%	2'988'780.00	0.05	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	9'620	1'500	0	11'120 CHF	93.87%	10'438'344.00	0.17	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'200	0	0	1'200 CHF	96.25%	1'155'000.00	0.02	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	3'200	0	0	3'200 CHF	94.95%	3'038'400.00	0.05	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	2'040	500	0	2'540 CHF	85.65%	2'175'510.00	0.04	a)
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	1'890	0	0	1'890 CHF	85.40%	1'614'060.00	0.03	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	8'740	0	0	8'740 CHF	95.25%	8'324'850.00	0.13	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	4'600	2'000	0	6'600 CHF	92.45%	6'101'700.00	0.10	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	2'535	0	0	2'535 CHF	86.25%	2'186'437.50	0.04	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	2'350	0	0	2'350 CHF	98.42%	2'312'870.00	0.04	a)
CH0385997116	0.7000 % NEUNBG 0.7 11/23/37	900	0	0	900 CHF	86.50%	778'500.00	0.01	a)
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	1'710	0	0	1'710 CHF	88.65%	1'515'915.00	0.02	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	2'000	400	0	2'400 CHF	93.75%	2'250'000.00	0.04	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	5'740	0	0	5'740 CHF	94.15%	5'404'210.00	0.09	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	2'100	0	0	2'100 CHF	91.25%	1'916'250.00	0.03	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	560	0	0	560 CHF	95.85%	536'760.00	0.01	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	1'120	0	0	1'120 CHF	93.75%	1'050'000.00	0.02	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	3'480	0	0	3'480 CHF	93.35%	3'248'580.00	0.05	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	12'200	0	2'000	10'200 CHF	95.77%	9'768'540.00	0.16	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	1'230	0	0	1'230 CHF	92.90%	1'142'670.00	0.02	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	1'840	0	0	1'840 CHF	96.45%	1'774'680.00	0.03	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	1'550	0	0	1'550 CHF	94.45%	1'463'975.00	0.02	a)
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	500	0	0	500 CHF	97.41%	487'050.00	0.01	a)
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	3'900	0	0	3'900 CHF	97.04%	3'784'560.00	0.06	a)
CH0398633336	0.3500 % WKBNSW 0.35 09/07/27	2'000	0	0	2'000 CHF	93.45%	1'869'000.00	0.03	a)
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	0	2'900	0	2'900 CHF	92.50%	2'682'500.00	0.04	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'270	1'500	0	2'770 CHF	95.05%	2'632'885.00	0.04	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	0	2'550	0	2'550 CHF	92.25%	2'352'375.00	0.04	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	6'900	0	1'000	5'900 CHF	95.42%	5'629'780.00	0.09	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	6'780	1'000	0	7'780 CHF	91.34%	7'106'252.00	0.12	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	5'000	0	0	5'000 CHF	97.93%	4'896'500.00	0.08	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	7'380	4'000	0	11'380 CHF	94.00%	10'697'200.00	0.17	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	410	0	0	410 CHF	95.00%	389'500.00	0.01	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	1'390	0	0	1'390 CHF	92.45%	1'285'055.00	0.02	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'000	0	0	2'000 CHF	94.05%	1'881'000.00	0.03	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	3'620	0	0	3'620 CHF	87.70%	3'174'740.00	0.05	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	1'520	0	0	1'520 CHF	78.55%	1'193'960.00	0.02	a)
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	2'810	0	0	2'810 CHF	98.02%	2'754'362.00	0.04	a)
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'800	0	0	1'800 CHF	93.70%	1'686'600.00	0.03	a)
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	2'000	0	0	2'000 CHF	95.60%	1'912'000.00	0.03	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	4'470	1'000	0	5'470 CHF	94.70%	5'180'090.00	0.08	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	750	0	0	750 CHF	91.30%	684'750.00	0.01	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	96.05%	3'025'575.00	0.05	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'540	0	0	1'540 CHF	94.15%	1'449'910.00	0.02	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	1'900	0	0	1'900 CHF	92.30%	1'753'700.00	0.03	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.02	a)
CH0406415247	0.1250 % PSYHYPO 0 1/8 04/26/24 658	8'250	0	8'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	1'110	0	0	1'110 CHF	97.15%	1'078'365.00	0.02	a)
CH0406415304	0.2000 % LANSBK 0.2 04/17/26 EMTN	1'940	500	0	2'440 CHF	95.20%	2'322'880.00	0.04	a)
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	2'400	1'000	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	96.15%	1'778'775.00	0.03	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	1'720	0	0	1'720 CHF	97.15%	1'670'980.00	0.03	a)
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	1'110	0	0	1'110 CHF	93.35%	1'036'185.00	0.02	a)
CH041015144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	4'600	0	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	6'000	0	2'000	4'000 CHF	94.30%	3'772'000.00	0.06	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	2'830	1'500	0	4'330 CHF	96.75%	4'189'275.00	0.07	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	97.05%	2'135'100.00	0.03	a)
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	5'470	0	0	5'470 CHF	93.50%	5'114'450.00	0.08	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	2'500	0	0	2'500 CHF	93.80%	2'345'000.00	0.04	a)
CH0419040735	0.3000 % WKBNWSW 0.3 02/01/27	1'800	0	0	1'800 CHF	94.15%	1'694'700.00	0.03	a)
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	2'190	1'800	0	3'990 CHF	90.55%	3'612'945.00	0.06	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	4'600	0	0	4'600 CHF	93.70%	4'310'200.00	0.07	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	1'700	0	0	1'700 CHF	92.50%	1'572'500.00	0.03	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	7'850	4'000	0	11'850 CHF	91.48%	10'840'380.00	0.18	a)
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	900	0	0	900 CHF	89.15%	802'350.00	0.01	a)
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	3'550	0	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	1'300	400	0	1'700 CHF	87.40%	1'485'800.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	11'150	0	0	11'150 CHF	92.26%	10'286'990.00	0.17	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	4'310	1'000	0	5'310 CHF	85.65%	4'548'015.00	0.07	a)
CH0419040974	0.8500 % KBLUZE 0.85 03/12/42	2'800	0	0	2'800 CHF	93.45%	2'336'600.00	0.04	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'000	600	0	2'600 CHF	93.80%	2'438'800.00	0.04	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'330	0	0	1'330 CHF	95.55%	1'270'815.00	0.02	a)
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	780	0	0	780 CHF	92.20%	719'160.00	0.01	a)
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	1'200	0	0	1'200 CHF	95.00%	1'140'000.00	0.02	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	1'900	0	0	1'900 CHF	93.75%	1'781'250.00	0.03	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'330	1'000	0	4'330 CHF	90.70%	3'927'310.00	0.06	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	1'440	0	0	1'440 CHF	87.55%	1'260'720.00	0.02	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	500	0	0	500 CHF	96.56%	482'800.00	0.01	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	7'400	0	0	7'400 CHF	91.10%	6'741'400.00	0.11	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	7'000	0	0	7'000 CHF	87.70%	6'139'000.00	0.10	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	1'260	0	0	1'260 CHF	85.90%	1'082'340.00	0.02	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'400	0	0	2'400 CHF	90.65%	2'175'600.00	0.04	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	1'060	0	0	1'060 CHF	80.55%	853'830.00	0.01	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	5'320	1'000	0	6'320 CHF	89.10%	5'631'120.00	0.09	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	2'700	0	0	2'700 CHF	91.75%	2'477'250.00	0.04	a)
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	2'900	0	0	2'900 CHF	78.40%	2'273'600.00	0.04	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	2'050	0	0	2'050 CHF	81.45%	1'669'725.00	0.03	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'420	0	0	1'420 CHF	89.15%	1'265'930.00	0.02	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	3'000	500	0	3'500 CHF	78.50%	2'747'500.00	0.04	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	2'500	0	800	1'700 CHF	73.05%	1'241'850.00	0.02	a)
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	800	0	0	800 CHF	69.20%	553'600.00	0.01	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	4'700	0	0	4'700 CHF	72.55%	3'409'850.00	0.06	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	1'440	0	0	1'440 CHF	88.60%	1'275'840.00	0.02	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	2'250	800	0	3'050 CHF	93.20%	2'842'600.00	0.05	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	1'800	0	0	1'800 CHF	95.60%	1'720'800.00	0.03	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	2'100	0	500	1'600 CHF	96.00%	1'536'000.00	0.02	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	3'330	0	0	3'330 CHF	98.48%	3'279'384.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	7'350	2'000	0	9'350 CHF	96.41%	9'014'335.00	0.15	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	7'500	1'890	0	9'390 CHF	93.34%	8'764'626.00	0.14	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'420	0	0	1'420 CHF	95.30%	1'353'260.00	0.02	a)
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	2'200	1'000	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	8'860	1'200	0	10'060 CHF	93.35%	9'391'010.00	0.15	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'250	0	0	2'250 CHF	87.87%	1'977'075.00	0.03	a)
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	500	0	0	500 CHF	98.65%	493'250.00	0.01	a)
CH0434678352	1.1250 % BOBST 1 1/8 09/27/24	0	1'850	0	1'850 CHF	98.57%	1'823'545.00	0.03	a)
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'510	0	0	1'510 CHF	96.40%	1'455'640.00	0.02	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	6'300	0	0	6'300 CHF	94.42%	5'948'460.00	0.10	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	500	2'250	0	2'750 CHF	88.50%	2'433'750.00	0.04	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	3'550	0	0	3'550 CHF	99.02%	3'515'210.00	0.06	a)
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	720	0	0	720 CHF	92.75%	667'800.00	0.01	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	4'950	1'500	0	6'450 CHF	97.10%	6'262'950.00	0.10	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	93.05%	1'721'425.00	0.03	a)
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	99.10%	2'725'250.00	0.04	a)
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	1'720	0	0	1'720 CHF	97.69%	1'680'268.00	0.03	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	5'250	750	0	6'000 CHF	88.42%	5'305'200.00	0.09	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	17'570	15'700	0	33'270 CHF	89.87%	29'899'749.00	0.48	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	31'760	0	500	31'260 CHF	85.08%	26'596'008.00	0.43	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	10'600	7'000	0	17'600 CHF	106.82%	18'800'320.00	0.30	a)
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	800	0	0	800 CHF	91.00%	728'000.00	0.01	a)
CH0441186472	1.6300 % CPIPGR 1.63 10/25/23 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	96.05%	768'400.00	0.01	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	7'950	0	0	7'950 CHF	94.77%	7'534'215.00	0.12	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	8'840	0	0	8'840 CHF	96.05%	8'490'820.00	0.14	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	1'900	0	0	1'900 CHF	97.75%	1'857'250.00	0.03	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	900	0	0	900 CHF	95.45%	859'050.00	0.01	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	3'530	0	0	3'530 CHF	94.30%	3'328'790.00	0.05	a)
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0445625004	0.0000 % KTBS 0 11/28/23	3'580	0	3'580	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'800	0	0	1'800 CHF	95.35%	1'716'300.00	0.03	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	1'000	1'000	0	2'000 CHF	93.65%	1'873'000.00	0.03	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	1'000	0	0	1'000 CHF	89.60%	896'000.00	0.01	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	7'050	0	0	7'050 CHF	95.01%	6'698'205.00	0.11	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	1'120	0	0	1'120 CHF	89.05%	997'360.00	0.02	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	92.55%	1'665'900.00	0.03	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	3'700	0	0	3'700 CHF	92.90%	3'437'300.00	0.06	a)
CH0457206842	0.0010 % MUNHYP 0.001 02/19/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	2'800	0	0	2'800 CHF	93.25%	2'611'000.00	0.04	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	2'930	0	0	2'930 CHF	94.10%	2'757'130.00	0.04	a)
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	300	0	0	300 CHF	95.55%	286'650.00	0.00	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	1'600	0	0	1'600 CHF	91.85%	1'469'600.00	0.02	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	7'000	0	0	7'000 CHF	85.35%	5'974'500.00	0.10	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	92.15%	2'488'050.00	0.04	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	86.85%	2'431'800.00	0.04	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	91.45%	1'737'550.00	0.03	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	3'300	0	0	3'300 CHF	95.20%	3'141'600.00	0.05	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'900	0	0	1'900 CHF	81.45%	1'547'550.00	0.03	a)
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	12'120	0	0	12'120 CHF	87.34%	10'585'608.00	0.17	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	500	0	0	500 CHF	91.40%	457'000.00	0.01	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	1'000	0	0	1'000 CHF	86.10%	861'000.00	0.01	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	77.95%	2'026'700.00	0.03	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	9'450	0	1'000	8'450 CHF	80.80%	6'827'600.00	0.11	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'750	0	0	1'750 CHF	82.85%	1'449'875.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	5'430	0	0	5'430 CHF	87.65%	4'759'395.00	0.08	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	7'425	0	0	7'425 CHF	87.40%	6'489'450.00	0.11	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	7'260	0	0	7'260 CHF	86.87%	6'306'762.00	0.10	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	86.75%	867'500.00	0.01	a)
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	610	0	0	610 CHF	92.65%	565'165.00	0.01	a)
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	2'600	0	1'000	1'600 CHF	96.95%	1'551'200.00	0.03	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	97.60%	1'268'800.00	0.02	a)
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	4'300	0	0	4'300 CHF	87.45%	3'760'350.00	0.06	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	5'000	0	1'300	3'700 CHF	95.55%	3'535'350.00	0.06	a)
CH0467182454	1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.87%	1'937'400.00	0.03	a)
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'720	0	0	1'720 CHF	91.15%	1'567'780.00	0.03	a)
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	5'650	0	0	5'650 CHF	98.17%	5'546'605.00	0.09	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	7'200	0	0	7'200 CHF	90.70%	6'530'400.00	0.11	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	7'360	0	0	7'360 CHF	92.20%	6'785'920.00	0.11	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	2'600	0	0	2'600 CHF	96.95%	2'520'700.00	0.04	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'400	0	0	1'400 CHF	98.80%	1'383'200.00	0.02	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	89.50%	1'163'500.00	0.02	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	97.23%	1'069'530.00	0.02	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'440	0	0	1'440 CHF	90.50%	1'303'200.00	0.02	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	830	0	0	830 CHF	97.50%	809'250.00	0.01	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	8'900	0	0	8'900 CHF	91.20%	8'116'800.00	0.13	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	95.05%	475'250.00	0.01	a)
CH0477380916	0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29	2'000	0	0	2'000 CHF	90.75%	1'815'000.00	0.03	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	4'510	0	0	4'510 CHF	87.55%	3'948'505.00	0.06	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'520	0	0	1'520 CHF	88.70%	1'348'240.00	0.02	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	92.00%	2'300'000.00	0.04	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	7'290	0	0	7'290 CHF	89.02%	6'489'558.00	0.11	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	2'280	1'500	0	3'780 CHF	80.70%	3'050'460.00	0.05	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	400	0	0	400 CHF	96.75%	387'000.00	0.01	a)
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	1'030	0	0	1'030 CHF	88.75%	914'125.00	0.01	a)
CH0483181001	0.0000 % CS 0 07/16/29 EMTN	1'925	0	0	1'925 CHF	87.60%	1'686'300.00	0.03	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	5'970	800	500	6'270 CHF	81.40%	5'103'780.00	0.08	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	6'050	1'500	0	7'550 CHF	93.27%	7'041'885.00	0.11	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	8'950	2'000	0	10'950 CHF	85.40%	9'351'300.00	0.15	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	4'960	0	0	4'960 CHF	78.39%	3'888'144.00	0.06	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	12'315	0	0	12'315 CHF	66.82%	8'228'883.00	0.13	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	1'370	0	0	1'370 CHF	88.30%	1'209'710.00	0.02	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	2'840	0	0	2'840 CHF	68.10%	1'934'040.00	0.03	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	440	0	0	440 CHF	93.05%	409'420.00	0.01	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	1'900	0	0	1'900 CHF	92.20%	1'751'800.00	0.03	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	1'540	0	0	1'540 CHF	80.45%	1'238'930.00	0.02	a)
CH0485445958	0.0000 % KOHNPW 0 07/19/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.90%	1'958'000.00	0.03	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	91.15%	1'549'550.00	0.03	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	2'690	0	0	2'690 CHF	96.15%	2'586'435.00	0.04	a)
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	1'650	0	0	1'650 CHF	87.20%	1'438'800.00	0.02	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	1'030	0	0	1'030 CHF	93.20%	959'960.00	0.02	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	4'350	0	1'500	2'850 CHF	96.30%	2'744'550.00	0.04	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	84.15%	1'767'150.00	0.03	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	2'850	500	0	3'350 CHF	58.50%	1'959'750.00	0.03	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	670	0	0	670 CHF	63.80%	427'460.00	0.01	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	500	0	0	500 CHF	95.05%	475'250.00	0.01	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	500	0	0	500 CHF	85.15%	425'750.00	0.01	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	3'650	0	1'800	1'850 CHF	88.15%	1'630'775.00	0.03	a)
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	1'320	0	0	1'320 CHF	65.40%	863'280.00	0.01	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	6'570	0	0	6'570 CHF	95.24%	6'257'268.00	0.10	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	94.55%	1'418'250.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	2'060	0	0	2'060 CHF	92.30%	1'901'380.00	0.03	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	3'100	0	0	3'100 CHF	87.55%	2'714'050.00	0.04	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	3'330	0	0	3'330 CHF	80.75%	2'688'975.00	0.04	a)
CH0505011962	0.4500 % BSTDBK 0.45 06/13/23	2'785	0	2'785	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	4'440	0	0	4'440 CHF	88.55%	3'931'620.00	0.06	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	1'680	250	0	1'930 CHF	88.10%	1'700'330.00	0.03	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	5'100	0	0	5'100 CHF	91.15%	4'648'650.00	0.08	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	7'400	500	0	7'900 CHF	87.60%	6'920'400.00	0.11	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	3'570	800	0	4'370 CHF	75.30%	3'290'610.00	0.05	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	1'990	0	0	1'990 CHF	90.35%	1'797'965.00	0.03	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	3'850	0	0	3'850 CHF	88.30%	3'399'550.00	0.06	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	91.90%	1'838'000.00	0.03	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	2'150	0	0	2'150 CHF	89.45%	1'923'175.00	0.03	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	2'600	0	0	2'600 CHF	89.95%	2'338'700.00	0.04	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'000	0	0	1'000 CHF	91.60%	916'000.00	0.01	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	800	0	0	800 CHF	90.50%	724'000.00	0.01	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	7'290	0	800	6'490 CHF	85.20%	5'529'480.00	0.09	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'000	400	0	1'400 CHF	94.80%	1'327'200.00	0.02	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	2'160	850	0	3'010 CHF	86.55%	2'605'155.00	0.04	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	4'200	1'000	0	5'200 CHF	95.00%	4'940'000.00	0.08	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'660	800	0	2'460 CHF	81.65%	2'008'590.00	0.03	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	96.10%	1'537'600.00	0.02	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	6'400	0	0	6'400 CHF	87.60%	5'606'400.00	0.09	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	1'620	0	0	1'620 CHF	81.20%	1'315'440.00	0.02	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	2'400	0	0	2'400 CHF	89.30%	2'143'200.00	0.03	a)
CH0511762038	0.5225 % AFRFIN 0.5225 12/20/23 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	4'600	0	0	4'600 CHF	93.58%	4'304'680.00	0.07	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	6'580	0	1'000	5'580 CHF	87.50%	4'882'500.00	0.08	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	89.55%	2'865'600.00	0.05	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	5'870	0	1'700	4'170 CHF	96.90%	4'040'730.00	0.07	a)
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	0	3'150	0	3'150 CHF	95.70%	3'014'550.00	0.05	a)
CH0520663581	0.0000 % CS 0 07/31/25 EMTN	4'120	0	0	4'120 CHF	95.60%	3'938'720.00	0.06	a)
CH0520663599	0.0000 % CS 0 10/31/30 EMTN	4'550	0	0	4'550 CHF	85.15%	3'874'325.00	0.06	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	600	0	0	600 CHF	85.25%	511'500.00	0.01	a)
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	2'950	0	0	2'950 CHF	81.50%	2'404'250.00	0.04	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBNSW 0 02/14/29	2'100	0	0	2'100 CHF	89.60%	1'881'600.00	0.03	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	4'850	500	0	5'350 CHF	81.15%	4'341'525.00	0.07	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	1'850	0	0	1'850 CHF	88.90%	1'644'650.00	0.03	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	4'600	0	500	4'100 CHF	83.15%	3'409'150.00	0.06	a)
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	2'340	1'000	0	3'340 CHF	88.15%	2'944'210.00	0.05	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	1'100	0	0	1'100 CHF	87.25%	959'750.00	0.02	a)
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	520	250	0	770 CHF	87.90%	676'830.00	0.01	a)
CH0522158960	0.3126 % KBFRIB 0.3126 02/02/32	3'000	0	0	3'000 CHF	87.30%	2'619'000.00	0.04	a)
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	4'900	0	0	4'900 CHF	88.40%	4'331'600.00	0.07	a)
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	2'100	250	0	2'350 CHF	90.20%	2'119'700.00	0.03	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	700	1'500	0	2'200 CHF	94.70%	2'083'400.00	0.03	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	3'500	0	1'200	2'300 CHF	95.45%	2'195'350.00	0.04	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	2'700	0	0	2'700 CHF	96.90%	2'616'300.00	0.04	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	1'500	0	0	1'500 CHF	97.75%	1'466'250.00	0.02	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	2'500	0	0	2'500 CHF	96.95%	2'423'750.00	0.04	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	7'040	1'000	0	8'040 CHF	92.18%	7'411'272.00	0.12	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	4'950	0	1'000	3'950 CHF	68.69%	2'713'255.00	0.04	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	2'840	0	0	2'840 CHF	98.28%	2'791'041.24	0.05	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	7'400	0	0	7'400 CHF	89.25%	6'604'500.00	0.11	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	1'700	0	0	1'700 CHF	93.75%	1'593'750.00	0.03	a)
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	1'700	1'500	0	3'200 CHF	93.05%	2'977'600.00	0.05	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	3'000	0	0	3'000 CHF	99.10%	2'973'000.00	0.05	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	9'420	0	9'420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	6'970	0	0	6'970 CHF	86.90%	6'056'930.00	0.10	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	3'480	0	0	3'480 CHF	75.15%	2'615'220.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	5'030	1'000	0	6'030 CHF	92.75%	5'592'825.00	0.09	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	3'970	600	0	4'570 CHF	73.55%	3'361'235.00	0.05	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	5'600	0	0	5'600 CHF	89.27%	4'999'120.00	0.08	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522	3'600	0	0	3'600 CHF	78.15%	2'813'400.00	0.05	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	6'700	350	0	7'050 CHF	83.40%	5'879'700.00	0.10	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	7'140	900	1'000	7'040 CHF	91.90%	6'469'760.00	0.10	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	6'635	0	0	6'635 CHF	82.42%	5'468'567.00	0.09	a)
CH0536893362	0.1500 % WKBSW 0.15 10/05/32	3'200	1'000	0	4'200 CHF	84.80%	3'561'600.00	0.06	a)
CH0536893370	0.6250 % SWICA 2020-1 A	1'210	0	1'210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	8'895	0	1'500	7'395 CHF	88.70%	6'559'365.00	0.11	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	2'900	0	0	2'900 CHF	71.20%	2'064'800.00	0.03	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	1'570	1'500	0	3'070 CHF	86.80%	2'664'760.00	0.04	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	2'140	0	0	2'140 CHF	79.50%	1'701'300.00	0.03	a)
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	800	0	0	800 CHF	84.40%	675'200.00	0.01	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	6'600	0	600	6'000 CHF	93.50%	5'610'000.00	0.09	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	3'750	0	0	3'750 CHF	81.35%	3'050'625.00	0.05	a)
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'000	0	0	1'000 CHF	94.20%	942'000.00	0.02	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	11'600	1'500	1'500	11'600 CHF	92.40%	10'718'400.00	0.17	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'640	0	0	2'640 CHF	97.05%	2'562'120.00	0.04	a)
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	1'390	0	0	1'390 CHF	85.40%	1'187'060.00	0.02	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'670	0	0	1'670 CHF	91.90%	1'534'730.00	0.02	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	2'750	0	0	2'750 CHF	87.50%	2'406'250.00	0.04	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	2'430	0	0	2'430 CHF	90.55%	2'200'365.00	0.04	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	3'050	0	0	3'050 CHF	79.30%	2'418'650.00	0.04	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.35%	1'927'000.00	0.03	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	1'640	1'000	0	2'640 CHF	96.80%	2'555'520.00	0.04	a)
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	3'410	1'570	0	4'980 CHF	89.55%	4'459'590.00	0.07	a)
CH0550413352	0.0000 % CS 0 12/17/24 EMTN	1'730	0	0	1'730 CHF	96.94%	1'677'062.00	0.03	a)
CH0550413360	0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN	5'200	0	0	5'200 CHF	91.10%	4'737'200.00	0.08	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	1'000	500	0	1'500 CHF	88.25%	1'323'750.00	0.02	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	1'000	0	0	1'000 CHF	75.25%	752'500.00	0.01	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	2'200	600	0	2'800 CHF	94.05%	2'633'400.00	0.04	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	5'160	0	0	5'160 CHF	75.95%	3'919'020.00	0.06	a)
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	2'010	0	0	2'010 CHF	70.50%	1'417'050.00	0.02	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	1'180	0	0	1'180 CHF	67.90%	801'220.00	0.01	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'210	0	0	5'210 CHF	89.45%	4'660'345.00	0.08	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	5'800	0	0	5'800 CHF	76.90%	4'460'200.00	0.07	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	5'300	1'000	0	6'300 CHF	96.90%	6'104'700.00	0.10	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	22'420	4'300	0	26'720 CHF	91.50%	24'448'800.00	0.40	a)
CH0557778716	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 FEB	0	5'600	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778724	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 FEB	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778799	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 MAY	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778807	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 MAY	0	11'100	11'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	13'800	0	13'800 CHF	104.89%	14'474'820.00	0.23	a)
CH0557778823	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 JULY	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778831	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 JULY	0	4'700	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	3'300	0	0	3'300 CHF	97.25%	3'209'250.00	0.05	a)
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	1'780	0	0	1'780 CHF	56.40%	1'003'920.00	0.02	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	4'250	0	0	4'250 CHF	76.30%	3'242'750.00	0.05	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	2'190	0	0	2'190 CHF	88.55%	1'939'245.00	0.03	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	5'550	0	0	5'550 CHF	87.90%	4'878'450.00	0.08	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	3'770	0	0	3'770 CHF	76.00%	2'865'200.00	0.05	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	3'800	0	0	3'800 CHF	86.45%	3'285'100.00	0.05	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	930	0	0	930 CHF	72.50%	674'250.00	0.01	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	94.55%	3'214'700.00	0.05	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	3'120	0	0	3'120 CHF	89.65%	2'797'080.00	0.05	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	2'780	0	0	2'780 CHF	83.70%	2'326'860.00	0.04	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	3'040	500	0	3'540 CHF	89.45%	3'166'530.00	0.05	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	96.60%	1'642'200.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	2'160	0	0	2'160 CHF	86.60%	1'870'560.00	0.03	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'210	0	0	1'210 CHF	84.20%	1'018'820.00	0.02	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	13'600	0	0	13'600 CHF	89.01%	12'105'360.00	0.20	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	1'010	400	0	1'410 CHF	72.00%	1'015'200.00	0.02	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	3'000	0	0	3'000 CHF	92.55%	2'776'500.00	0.05	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	6'500	0	800	5'700 CHF	96.31%	5'489'670.00	0.09	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	4'250	0	0	4'250 CHF	84.96%	3'610'800.00	0.06	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	5'220	2'630	1'000	6'850 CHF	94.70%	6'486'950.00	0.11	a)
CH0575017014	0.6250 % SWMOB 2020-2 A	1'360	0	1'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	10'810	500	1'500	9'810 CHF	89.60%	8'789'760.00	0.14	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	9'410	0	0	9'410 CHF	85.92%	8'085'072.00	0.13	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	97.96%	1'175'520.00	0.02	a)
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	1'440	0	0	1'440 CHF	59.75%	860'400.00	0.01	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	2'000	0	0	2'000 CHF	93.95%	1'879'000.00	0.03	a)
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	980	0	0	980 CHF	87.00%	852'600.00	0.01	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	2'530	0	0	2'530 CHF	50.40%	1'275'120.00	0.02	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'630	2'020	0	3'650 CHF	90.40%	3'299'600.00	0.05	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	6'480	0	0	6'480 CHF	83.70%	5'423'760.00	0.09	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'500	0	0	1'500 CHF	96.55%	1'448'250.00	0.02	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	9'500	0	0	9'500 CHF	91.00%	8'645'000.00	0.14	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	9'100	0	0	9'100 CHF	84.70%	7'707'700.00	0.12	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	9'640	1'375	0	11'015 CHF	80.50%	8'867'075.00	0.14	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	8'200	0	0	8'200 CHF	87.37%	7'164'340.00	0.12	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	2'140	0	0	2'140 CHF	83.10%	1'778'340.00	0.03	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	5'900	0	0	5'900 CHF	72.94%	4'303'460.00	0.07	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	91.55%	1'098'600.00	0.02	a)
CH0591979650	0.0000 % CS 0 01/27/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	92.80%	1'577'600.00	0.03	a)
CH0591979668	0.0000 % CS 0 01/27/33 EMTN	2'700	0	800	1'900 CHF	79.50%	1'510'500.00	0.02	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	3'000	0	0	3'000 CHF	83.80%	2'514'000.00	0.04	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'800	0	0	1'800 CHF	93.50%	1'683'000.00	0.03	a)
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	2'370	0	0	2'370 CHF	85.85%	2'034'645.00	0.03	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	2'000	250	0	2'250 CHF	77.05%	1'733'625.00	0.03	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'940	0	0	2'940 CHF	74.00%	2'175'600.00	0.04	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	1'840	0	0	1'840 CHF	74.35%	1'368'040.00	0.02	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	85.00%	2'890'000.00	0.05	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	10'430	600	0	11'030 CHF	88.55%	9'767'065.00	0.16	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	2'200	0	0	2'200 CHF	86.25%	1'897'500.00	0.03	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	87.30%	1'746'000.00	0.03	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	2'600	0	0	2'600 CHF	95.50%	2'483'000.00	0.04	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	2'860	0	0	2'860 CHF	75.45%	2'157'870.00	0.03	a)
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	2'280	1'000	0	3'280 CHF	87.45%	2'868'360.00	0.05	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	3'200	0	800	2'400 CHF	81.60%	1'958'400.00	0.03	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	19'100	1'500	0	20'600 CHF	92.25%	19'003'500.00	0.31	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	5'400	0	1'500	3'900 CHF	86.42%	3'370'380.00	0.05	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	4'600	0	0	4'600 CHF	83.55%	3'843'300.00	0.06	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	5'010	1'000	0	6'010 CHF	86.00%	5'168'600.00	0.08	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	3'000	200	0	3'200 CHF	87.05%	2'785'600.00	0.05	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	1'650	0	0	1'650 CHF	89.10%	1'470'150.00	0.02	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	4'300	0	0	4'300 CHF	91.45%	3'932'350.00	0.06	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	3'000	0	0	3'000 CHF	89.05%	2'671'500.00	0.04	a)
CH1105672674	0.5000 % SWICA 2021-1 A	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	4'710	500	0	5'210 CHF	86.05%	4'483'205.00	0.07	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	8'170	2'000	0	10'170 CHF	88.20%	8'969'940.00	0.15	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	4'980	0	1'000	3'980 CHF	83.40%	3'319'320.00	0.05	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	6'710	0	1'000	5'710 CHF	77.99%	4'453'229.00	0.07	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	4'760	0	0	4'760 CHF	85.70%	4'079'320.00	0.07	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBNSW 0.1 04/18/31	3'800	0	0	3'800 CHF	87.00%	3'306'000.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	800	0	0	800 CHF	94.40%	755'200.00	0.01	a)
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	3'300	0	0	3'300 CHF	84.90%	2'801'700.00	0.05	a)
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	3'020	0	0	3'020 CHF	88.80%	2'681'760.00	0.04	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	2'100	0	0	2'100 CHF	90.55%	1'901'550.00	0.03	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	91.00%	1'547'000.00	0.03	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	5'900	1'500	1'000	6'400 CHF	86.85%	5'558'400.00	0.09	a)
CH1112940601	0.0500 % NIDKBK 0.05 05/27/31	2'110	0	0	2'110 CHF	86.80%	1'831'480.00	0.03	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	5'290	0	0	5'290 CHF	85.70%	4'533'530.00	0.07	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	4'320	0	0	4'320 CHF	86.85%	3'751'920.00	0.06	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	0	3'550	0	3'550 CHF	95.10%	3'376'050.00	0.05	a)
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	4'000	0	500	3'500 CHF	87.55%	3'064'250.00	0.05	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	2'900	0	700	2'200 CHF	89.70%	1'973'400.00	0.03	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	8'800	0	0	8'800 CHF	86.45%	7'607'600.00	0.12	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	2'550	0	0	2'550 CHF	77.30%	1'971'150.00	0.03	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	87.80%	1'317'000.00	0.02	a)
CH1118483663	0.3500 % SWICC 2021-1 A	1'280	0	0	1'280 CHF	98.01%	1'254'586.88	0.02	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	1'800	0	500	1'300 CHF	92.10%	1'197'300.00	0.02	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	85.65%	2'141'250.00	0.03	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	3'900	0	600	3'300 CHF	92.60%	3'055'800.00	0.05	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	2'890	0	0	2'890 CHF	76.00%	2'196'400.00	0.04	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	1'220	0	0	1'220 CHF	78.95%	963'190.00	0.02	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'000	0	0	2'000 CHF	74.40%	1'488'000.00	0.02	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33	2'900	0	0	2'900 CHF	83.10%	2'409'900.00	0.04	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	1'960	0	0	1'960 CHF	81.40%	1'595'440.00	0.03	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	8'380	1'000	0	9'380 CHF	86.91%	8'152'158.00	0.13	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	3'400	0	0	3'400 CHF	79.65%	2'708'100.00	0.04	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	3'300	0	0	3'300 CHF	87.10%	2'874'300.00	0.05	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	87.15%	1'743'000.00	0.03	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	4'330	0	1'000	3'330 CHF	83.00%	2'763'900.00	0.04	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	2'350	0	0	2'350 CHF	89.95%	2'113'825.00	0.03	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	600	0	0	600 CHF	89.75%	538'500.00	0.01	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	2'100	0	0	2'100 CHF	84.40%	1'772'400.00	0.03	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	4'170	1'200	0	5'370 CHF	87.95%	4'722'915.00	0.08	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	6'800	2'000	2'000	6'800 CHF	83.17%	5'655'560.00	0.09	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	3'300	1'000	0	4'300 CHF	84.65%	3'639'950.00	0.06	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	2'530	0	0	2'530 CHF	95.70%	2'421'210.00	0.04	a)
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	1'460	0	0	1'460 CHF	90.20%	1'316'920.00	0.02	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	89.80%	1'975'600.00	0.03	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	3'780	0	0	3'780 CHF	87.75%	3'316'950.00	0.05	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	89.70%	1'166'100.00	0.02	a)
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	0	500	0	500 CHF	86.80%	434'000.00	0.01	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	3'300	0	0	3'300 CHF	93.95%	3'100'350.00	0.05	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	1'920	0	0	1'920 CHF	90.15%	1'730'880.00	0.03	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	2'100	0	0	2'100 CHF	70.30%	1'476'300.00	0.02	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	2'500	0	0	2'500 CHF	82.20%	2'055'000.00	0.03	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	3'000	0	0	3'000 CHF	96.55%	2'896'500.00	0.05	a)
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	2'350	0	0	2'350 CHF	89.40%	2'100'900.00	0.03	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	1'500	0	0	1'500 CHF	67.35%	1'010'250.00	0.02	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	91.85%	2'663'650.00	0.04	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	91.80%	3'304'800.00	0.05	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	92.40%	2'494'800.00	0.04	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	3'350	0	0	3'350 CHF	87.91%	2'944'985.00	0.05	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'700	800	0	2'500 CHF	88.85%	2'221'250.00	0.04	a)
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	0	2'275	0	2'275 CHF	87.90%	1'999'725.00	0.03	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	3'925	0	0	3'925 CHF	91.68%	3'598'440.00	0.06	a)
CH1148266245	0.3000 % WKBSNW 0.3 02/07/30	300	0	0	300 CHF	91.30%	273'900.00	0.00	a)
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	1'700	500	0	2'200 CHF	89.60%	1'971'200.00	0.03	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	86.80%	2'083'200.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	89.30%	2'589'700.00	0.04	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	6'200	700	0	6'900 CHF	87.97%	6'069'930.00	0.10	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	3'900	750	0	4'650 CHF	89.10%	4'143'150.00	0.07	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'900	0	0	2'900 CHF	84.75%	2'457'750.00	0.04	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	2'100	0	0	2'100 CHF	88.09%	1'849'890.00	0.03	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	1'500	1'500	0	3'000 CHF	79.30%	2'379'000.00	0.04	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	2'400	0	800	1'600 CHF	91.35%	1'461'600.00	0.02	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	3'750	0	0	3'750 CHF	94.36%	3'538'500.00	0.06	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	3'900	0	0	3'900 CHF	91.50%	3'568'500.00	0.06	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	1'900	0	0	1'900 CHF	88.10%	1'673'900.00	0.03	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	2'100	0	0	2'100 CHF	86.55%	1'817'550.00	0.03	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	10'900	0	0	10'900 CHF	87.45%	9'532'050.00	0.15	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	2'200	0	0	2'200 CHF	91.30%	2'008'600.00	0.03	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'500	1'000	0	3'500 CHF	83.09%	2'908'150.00	0.05	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'900	250	0	4'150 CHF	93.80%	3'892'700.00	0.06	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	87.90%	1'098'750.00	0.02	a)
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	300	0	0	300 CHF	90.10%	270'300.00	0.00	a)
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	1'300	0	0	1'300 CHF	91.10%	1'184'300.00	0.02	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	0	2'000	0	2'000 CHF	95.06%	1'901'200.00	0.03	a)
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	1'800	0	0	1'800 CHF	88.90%	1'600'200.00	0.03	a)
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	1'300	0	0	1'300 CHF	90.10%	1'171'300.00	0.02	a)
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	2'100	0	0	2'100 CHF	92.90%	1'950'900.00	0.03	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	0	1'600	0	1'600 CHF	95.10%	1'521'600.00	0.02	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	0	1'500	0	1'500 CHF	89.20%	1'338'000.00	0.02	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'380	0	0	1'380 CHF	94.80%	1'308'240.00	0.02	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	94.80%	1'706'400.00	0.03	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	1'550	0	0	1'550 CHF	73.55%	1'140'025.00	0.02	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	3'800	0	0	3'800 CHF	94.10%	3'575'800.00	0.06	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	0	500	0	500 CHF	92.75%	463'750.00	0.01	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	3'900	0	0	3'900 CHF	93.26%	3'637'140.00	0.06	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	2'800	550	0	3'350 CHF	92.45%	3'097'075.00	0.05	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	1'800	0	0	1'800 CHF	90.80%	1'634'400.00	0.03	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	2'500	0	0	2'500 CHF	97.55%	2'438'750.00	0.04	a)
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	1'800	0	0	1'800 CHF	94.50%	1'701'000.00	0.03	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	1'060	0	0	1'060 CHF	93.90%	995'340.00	0.02	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	3'800	0	0	3'800 CHF	95.80%	3'640'400.00	0.06	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	3'800	1'000	0	4'800 CHF	97.00%	4'656'000.00	0.08	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	3'100	4'300	0	7'400 CHF	97.05%	7'181'700.00	0.12	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	4'300	1'800	0	6'100 CHF	95.00%	5'795'000.00	0.09	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'700	0	0	1'700 CHF	97.15%	1'651'550.00	0.03	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	95.55%	1'051'050.00	0.02	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	95.30%	2'096'600.00	0.03	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	94.95%	2'658'600.00	0.04	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	3'700	1'800	0	5'500 CHF	94.87%	5'217'850.00	0.08	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	1'700	0	0	1'700 CHF	89.00%	1'513'000.00	0.02	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	94.95%	1'614'150.00	0.03	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	95.85%	1'054'350.00	0.02	a)
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	3'000	0	0	3'000 CHF	93.35%	2'800'500.00	0.05	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	1'800	0	0	1'800 CHF	97.15%	1'748'700.00	0.03	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	2'200	0	0	2'200 CHF	93.60%	2'059'200.00	0.03	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	3'100	0	0	3'100 CHF	96.75%	2'999'250.00	0.05	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	1'700	0	0	1'700 CHF	94.90%	1'613'300.00	0.03	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	94.65%	2'176'950.00	0.04	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	3'100	500	0	3'600 CHF	95.65%	3'443'400.00	0.06	a)
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	94.95%	2'278'800.00	0.04	a)
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	96.15%	2'307'600.00	0.04	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	2'400	0	0	2'400 CHF	94.25%	2'262'000.00	0.04	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	5'750	5'900	0	11'650 CHF	97.10%	11'312'150.00	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	6'800	800	2'000	5'600 CHF	98.51%	5'516'560.00	0.09	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	6'300	0	1'100	5'200 CHF	96.55%	5'020'600.00	0.08	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	1'400	750	0	2'150 CHF	95.35%	2'050'025.00	0.03	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	97.00%	3'395'000.00	0.06	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	2'800	500	0	3'300 CHF	96.80%	3'194'400.00	0.05	a)
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	98.45%	2'362'800.00	0.04	a)
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	2'500	0	0	2'500 CHF	96.85%	2'421'250.00	0.04	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	2'600	0	0	2'600 CHF	96.50%	2'509'000.00	0.04	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	3'300	0	0	3'300 CHF	97.35%	3'212'550.00	0.05	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	3'650	0	0	3'650 CHF	97.85%	3'571'525.00	0.06	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	2'040	0	0	2'040 CHF	98.00%	1'999'200.00	0.03	a)
CH1189217768	1.7000 % KTSPLB 1.7 06/24/32	0	2'000	0	2'000 CHF	95.40%	1'908'000.00	0.03	a)
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	6'300	2'900	0	9'200 CHF	98.45%	9'057'400.00	0.15	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	11'400	0	0	11'400 CHF	99.55%	11'348'700.00	0.18	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	3'300	4'000	0	7'300 CHF	101.80%	7'431'400.00	0.12	a)
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	3'200	0	0	3'200 CHF	107.30%	3'433'600.00	0.06	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	3'300	0	0	3'300 CHF	98.66%	3'255'780.00	0.05	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	2'700	8'140	0	10'840 CHF	99.10%	10'742'440.00	0.17	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	2'900	3'250	0	6'150 CHF	100.55%	6'183'825.00	0.10	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	3'100	0	0	3'100 CHF	97.40%	3'019'400.00	0.05	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	6'600	500	0	7'100 CHF	97.70%	6'936'700.00	0.11	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	2'200	0	0	2'200 CHF	96.90%	2'131'800.00	0.03	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	3'400	0	0	3'400 CHF	98.75%	3'357'500.00	0.05	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	2'000	750	0	2'750 CHF	96.95%	2'666'125.00	0.04	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	97.95%	1'665'150.00	0.03	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	2'000	0	0	2'000 CHF	99.25%	1'985'000.00	0.03	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	3'500	0	0	3'500 CHF	99.00%	3'465'000.00	0.06	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'680	0	0	1'680 CHF	98.90%	1'661'520.00	0.03	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	0	3'300	0	3'300 CHF	99.85%	3'295'050.00	0.05	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	0	2'250	0	2'250 CHF	102.00%	2'295'000.00	0.04	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	99.25%	3'076'750.00	0.05	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	4'700	0	0	4'700 CHF	102.85%	4'833'950.00	0.08	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	5'700	2'500	0	8'200 CHF	107.55%	8'819'100.00	0.14	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	2'900	3'100	0	6'000 CHF	114.07%	6'844'200.00	0.11	a)
CH1194355082	1.8750 % CS 1 7/8 06/29/26 EMTN	1'900	400	0	2'300 CHF	99.15%	2'280'450.00	0.04	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	2'000	900	0	2'900 CHF	97.50%	2'827'500.00	0.05	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	1'080	0	0	1'080 CHF	103.00%	1'112'400.00	0.02	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27	2'300	0	0	2'300 CHF	99.05%	2'278'150.00	0.04	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	0	1'800	0	1'800 CHF	104.85%	1'887'300.00	0.03	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	850	0	0	850 CHF	107.10%	910'350.00	0.01	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'800	0	0	1'800 CHF	97.45%	1'754'100.00	0.03	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	2'100	500	0	2'600 CHF	99.55%	2'588'300.00	0.04	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	1'100	0	0	1'100 CHF	102.45%	1'126'950.00	0.02	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	4'400	0	0	4'400 CHF	97.79%	4'302'760.00	0.07	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	4'300	800	0	5'100 CHF	101.65%	5'184'150.00	0.08	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	1'500	0	0	1'500 CHF	96.55%	1'448'250.00	0.02	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	1'800	500	0	2'300 CHF	97.55%	2'243'650.00	0.04	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	97.05%	2'329'200.00	0.04	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'610	0	0	2'610 CHF	97.75%	2'551'275.00	0.04	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	95.95%	2'014'950.00	0.03	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	3'700	0	0	3'700 CHF	96.70%	3'577'900.00	0.06	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	2'000	3'800	0	5'800 CHF	95.57%	5'543'060.00	0.09	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	1'500	250	0	1'750 CHF	96.00%	1'680'000.00	0.03	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	2'500	0	0	2'500 CHF	97.65%	2'441'250.00	0.04	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	2'400	250	0	2'650 CHF	97.20%	2'575'800.00	0.04	a)
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	3'300	0	0	3'300 CHF	99.70%	3'290'100.00	0.05	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	4'400	0	0	4'400 CHF	98.44%	4'331'360.00	0.07	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	3'400	1'800	0	5'200 CHF	101.62%	5'284'240.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	1'600	0	0	1'600 CHF	102.09%	1'633'440.00	0.03	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	4'200	0	0	4'200 CHF	104.60%	4'393'200.00	0.07	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	1'900	0	0	1'900 CHF	102.55%	1'948'450.00	0.03	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	2'600	0	0	2'600 CHF	100.15%	2'603'900.00	0.04	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	600	2'500	0	3'100 CHF	99.40%	3'081'400.00	0.05	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	5'100	0	0	5'100 CHF	102.30%	5'217'300.00	0.08	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	2'400	1'730	0	4'130 CHF	107.60%	4'443'880.00	0.07	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	1'615	0	0	1'615 CHF	108.50%	1'752'275.00	0.03	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	3'300	0	0	3'300 CHF	100.00%	3'300'000.00	0.05	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	3'800	1'500	0	5'300 CHF	99.40%	5'268'200.00	0.09	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	2'800	2'000	0	4'800 CHF	96.30%	4'622'400.00	0.07	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	3'100	300	0	3'400 CHF	98.75%	3'357'500.00	0.05	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	1'100	250	0	1'350 CHF	98.00%	1'323'000.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	700	500	0	1'200 CHF	99.00%	1'188'000.00	0.02	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	1'100	0	0	1'100 CHF	98.90%	1'087'900.00	0.02	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	98.60%	1'281'800.00	0.02	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	1'300	0	0	1'300 CHF	101.15%	1'314'950.00	0.02	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	98.95%	2'473'750.00	0.04	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	2'800	0	0	2'800 CHF	98.55%	2'759'400.00	0.04	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'800	500	0	3'300 CHF	99.95%	3'298'350.00	0.05	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	102.15%	2'860'200.00	0.05	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	4'000	3'000	0	7'000 CHF	102.35%	7'164'500.00	0.12	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	100.25%	1'102'750.00	0.02	a)
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	900	300	0	1'200 CHF	102.90%	1'234'800.00	0.02	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'700	0	0	1'700 CHF	100.00%	1'700'000.00	0.03	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	1'800	0	0	1'800 CHF	101.35%	1'824'300.00	0.03	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	900	0	0	900 CHF	99.60%	896'400.00	0.01	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	2'400	500	400	2'500 CHF	107.15%	2'678'750.00	0.04	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	1'500	0	1'500 CHF	100.15%	1'502'250.00	0.02	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	0	1'500	0	1'500 CHF	100.85%	1'512'750.00	0.02	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	1'300	0	1'300 CHF	99.95%	1'299'350.00	0.02	a)
CH1218301948	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 06/25/24 729	0	3'000	0	3'000 CHF	99.67%	2'990'100.00	0.05	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	2'600	0	0	2'600 CHF	102.80%	2'672'800.00	0.04	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	7'700	0	0	7'700 CHF	105.58%	8'129'660.00	0.13	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	102.10%	1'123'100.00	0.02	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	100.10%	3'103'100.00	0.05	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	960	0	0	960 CHF	116.55%	1'118'880.00	0.02	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	1'890	0	0	1'890 CHF	103.85%	1'962'765.00	0.03	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	2'880	0	600	2'280 CHF	102.75%	2'342'700.00	0.04	a)
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	2'700	1'000	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	3'800	1'800	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	100.30%	3'811'400.00	0.06	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	1'100	0	0	1'100 CHF	103.95%	1'143'450.00	0.02	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'800	0	0	2'800 CHF	99.00%	2'772'000.00	0.04	a)
CH1230442613	1.8750 % BCG 1 7/8 12/09/30	1'100	0	0	1'100 CHF	99.40%	1'093'400.00	0.02	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	98.25%	1'473'750.00	0.02	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32 EMTN	2'600	1'500	0	4'100 CHF	102.05%	4'184'050.00	0.07	a)
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	100.05%	1'900'950.00	0.03	a)
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	1'200	0	0	1'200 CHF	100.45%	1'205'400.00	0.02	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	0	3'200	0	3'200 CHF	100.50%	3'216'000.00	0.05	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	0	3'800	0	3'800 CHF	102.15%	3'881'700.00	0.06	a)
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	99.80%	1'397'200.00	0.02	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	800	500	0	1'300 CHF	99.75%	1'296'750.00	0.02	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	99.25%	2'084'250.00	0.03	a)
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	2'200	0	0	2'200 CHF	99.90%	2'197'800.00	0.04	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	810	250	0	1'060 CHF	98.81%	1'047'386.00	0.02	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	5'300	0	0	5'300 CHF	99.47%	5'271'910.00	0.09	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	6'700	0	0	6'700 CHF	100.45%	6'730'150.00	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	1'100	0	0	1'100 CHF	98.90%	1'087'900.00	0.02	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBNSW 2.05 07/24/28	2'000	250	0	2'250 CHF	101.10%	2'274'750.00	0.04	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	2'400	0	0	2'400 CHF	98.55%	2'365'200.00	0.04	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	1'600	0	0	1'600 CHF	99.05%	1'584'800.00	0.03	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	1'100	0	0	1'100 CHF	99.05%	1'089'550.00	0.02	a)
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	99.65%	1'494'750.00	0.02	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	3'800	500	0	4'300 CHF	99.40%	4'274'200.00	0.07	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	2'200	1'250	0	3'450 CHF	100.50%	3'467'250.00	0.06	a)
CH1239464535	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 FEB	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464543	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 FEB	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	3'200	0	0	3'200 CHF	102.15%	3'268'800.00	0.05	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	1'600	0	0	1'600 CHF	106.35%	1'701'600.00	0.03	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'750	0	0	1'750 CHF	98.30%	1'720'250.00	0.03	a)
CH1239464618	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 MAR	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464626	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 MAR	0	4'200	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	0	6'530	0	6'530 CHF	104.85%	6'846'705.00	0.11	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	0	2'600	0	2'600 CHF	105.95%	2'754'700.00	0.04	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	2'700	0	2'700 CHF	114.80%	3'099'600.00	0.05	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	4'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	0	1'800	0	1'800 CHF	99.95%	1'799'100.00	0.03	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	0	4'400	0	4'400 CHF	101.54%	4'467'760.00	0.07	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	5'900	0	5'900 CHF	102.40%	6'041'600.00	0.10	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	3'310	0	3'310 CHF	103.60%	3'429'160.00	0.06	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	0	1'800	0	1'800 CHF	100.35%	1'806'300.00	0.03	a)
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	0	2'715	0	2'715 CHF	100.60%	2'731'290.00	0.04	a)
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	1'600	500	0	2'100 CHF	100.10%	2'102'100.00	0.03	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	2'300	0	0	2'300 CHF	99.81%	2'295'630.00	0.04	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	7'000	0	0	7'000 CHF	101.08%	7'075'600.00	0.11	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	665	0	0	665 CHF	102.00%	678'300.00	0.01	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'800	0	0	1'800 CHF	99.55%	1'791'900.00	0.03	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	3'200	500	0	3'700 CHF	98.85%	3'657'450.00	0.06	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	3'700	500	0	4'200 CHF	99.10%	4'162'200.00	0.07	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	98.30%	1'671'100.00	0.03	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	3'000	0	0	3'000 CHF	99.80%	2'994'000.00	0.05	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	98.25%	2'849'250.00	0.05	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	0	5'100	0	5'100 CHF	100.67%	5'134'170.00	0.08	a)
CH1243651960	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 FEB	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 FEB	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651986	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 MAR	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	1'200	0	0	1'200 CHF	101.35%	1'216'200.00	0.02	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	2'100	0	0	2'100 CHF	99.20%	2'083'200.00	0.03	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	1'200	0	0	1'200 CHF	98.95%	1'187'400.00	0.02	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	2'500	1'250	0	3'750 CHF	100.05%	3'751'875.00	0.06	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	2'100	0	2'100 CHF	99.95%	2'098'950.00	0.03	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	100.20%	2'204'400.00	0.04	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	101.50%	2'943'500.00	0.05	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	2'100	0	2'100 CHF	99.80%	2'095'800.00	0.03	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	99.60%	1'095'600.00	0.02	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	99.75%	1'396'500.00	0.02	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	0	900	0	900 CHF	101.00%	909'000.00	0.01	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.30%	1'003'000.00	0.02	a)
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	101.60%	3'860'800.00	0.06	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26	0	2'600	0	2'600 CHF	100.79%	2'620'540.00	0.04	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	0	3'900	0	3'900 CHF	102.35%	3'991'650.00	0.06	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	0	6'500	0	6'500 CHF	103.95%	6'756'750.00	0.11	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	4'500	0	4'500 CHF	99.95%	4'497'750.00	0.07	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	4'100	0	4'100 CHF	100.70%	4'128'700.00	0.07	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	0	7'000	0	7'000 CHF	101.95%	7'136'500.00	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	7'195	0	7'195 CHF	103.85%	7'472'007.50	0.12	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	2'700	0	2'700 CHF	101.50%	2'740'500.00	0.04	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	101.40%	2'737'800.00	0.04	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	2'000	0	2'000 CHF	99.85%	1'997'000.00	0.03	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	99.95%	2'198'900.00	0.04	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	0	2'100	0	2'100 CHF	100.45%	2'109'450.00	0.03	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	100.65%	2'616'900.00	0.04	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	4'300	0	4'300 CHF	100.50%	4'321'500.00	0.07	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.15%	5'007'500.00	0.08	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	0	3'300	0	3'300 CHF	101.70%	3'356'100.00	0.05	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	0	2'100	0	2'100 CHF	100.55%	2'111'550.00	0.03	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	4'900	0	4'900 CHF	103.00%	5'047'000.00	0.08	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	0	4'100	0	4'100 CHF	100.40%	4'116'400.00	0.07	a)
CH1264887352	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 MAY	0	5'285	5'285	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887360	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 MAY	0	2'695	2'695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887378	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 MAY	0	3'100	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	0	2'100	0	2'100 CHF	100.50%	2'110'500.00	0.03	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	0	1'110	0	1'110 CHF	124.95%	1'386'945.00	0.02	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	2'130	0	2'130 CHF	99.68%	2'123'184.00	0.03	a)
CH1266847115	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 JUN	0	3'940	3'940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	730	730	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	3'000	0	3'000 CHF	101.00%	3'030'000.00	0.05	a)
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	1'050	0	1'050 CHF	103.50%	1'086'750.00	0.02	a)
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 JUL	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	0	5'300	0	5'300 CHF	101.22%	5'364'660.00	0.09	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	5'500	0	5'500 CHF	102.73%	5'650'150.00	0.09	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	0	1'400	0	1'400 CHF	99.73%	1'396'234.00	0.02	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	3'700	0	3'700 CHF	99.65%	3'687'050.00	0.06	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	1'300	0	1'300 CHF	99.50%	1'293'500.00	0.02	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	0	1'800	0	1'800 CHF	100.31%	1'805'598.00	0.03	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	3'700	0	3'700 CHF	100.55%	3'720'350.00	0.06	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	1'750	0	1'750 CHF	100.25%	1'754'375.00	0.03	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	99.20%	1'488'000.00	0.02	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	100.40%	2'911'600.00	0.05	a)
CH1271360575	1.7500 % AIIB 1 3/4 06/26/30	0	2'100	0	2'100 CHF	100.55%	2'111'550.00	0.03	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	100.90%	2'219'800.00	0.04	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	0	2'800	0	2'800 CHF	98.85%	2'767'800.00	0.04	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	100.00%	1'900'000.00	0.03	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	100.60%	4'024'000.00	0.07	a)
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	0	1'000	0	1'000 CHF	99.70%	997'000.00	0.02	a)
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	100.20%	1'703'400.00	0.03	a)
CH1276313249	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 JUN	0	5'900	5'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	7'300	0	7'300 CHF	104.39%	7'620'470.00	0.12	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	3'200	0	3'200 CHF	105.65%	3'380'800.00	0.05	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	5'100	0	5'100 CHF	99.91%	5'095'410.00	0.08	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	0	5'900	0	5'900 CHF	99.88%	5'892'802.00	0.10	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	1'280	0	1'280 CHF	100.15%	1'281'920.00	0.02	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	101.60%	2'844'800.00	0.05	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	101.50%	2'233'000.00	0.04	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	102.25%	1'942'750.00	0.03	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	3'900	0	3'900 CHF	99.93%	3'897'192.00	0.06	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	1'500	0	1'500 CHF	100.25%	1'503'750.00	0.02	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	99.70%	1'894'300.00	0.03	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	100.35%	2'910'150.00	0.05	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	3'255	0	3'255 CHF	104.05%	3'386'827.50	0.05	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	0	2'600	0	2'600 CHF	101.00%	2'626'000.00	0.04	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	0	2'000	0	2'000 CHF	99.25%	1'985'000.00	0.03	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	0	3'600	0	3'600 CHF	99.70%	3'589'200.00	0.06	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	100.60%	1'207'200.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
----------------------------	-------------	------------------------------------	----------------------	-------------------------	---	------------	-----------------	------------	------

CHF 4'724'253'499.52 76.57

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

1'390'348'133.65 22.54

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

1'390'348'133.65 22.54

CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	13'066'022	2'432'765	532'345	14'966'443 CHF	92.90	1'390'348'133.65	22.54	a)
--------------	--	------------	-----------	---------	----------------	-------	------------------	-------	----

CHF 1'390'348'133.65 22.54

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	24'017'116.01	0.39
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'724'253'499.52	76.57
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'390'348'133.65	22.54
Sonstige Vermögenswerte	31'078'213.52	0.50
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'169'696'962.70	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-178'221.39	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'169'518'741.31	

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);	6'114'601'633.17	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

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.95574372
-----	---------	------------

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: 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
ASTT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.238	0.00 - 0.05	-	0.001
BVG 3 Index 45	CHF	0.00 - 0.44	-	0.238	0.00 - 0.05	-	0.001
DT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.238	0.00 - 0.05	-	0.001
FA CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.238	0.00 - 0.05	-	0.001
GT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.238	0.00 - 0.05	-	0.001
NT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.238	0.00 - 0.05	-	0.001

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
ASTT CHF	0.140	1.000	0.090	0.050	-
DT CHF	0.140	0.400	0.090	0.050	-
FA CHF	0.180	0.500	0.080	0.100	-
GT CHF	0.110	0.350	0.060	0.050	-
NT CHF	-	-	-	-	-

Periode: 01.02.2023 - 02.04.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
BVG 3 Index 45	0.710	6.000	0.580	0.130	-

Periode: 03.04.2023 - 01.05.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
BVG 3 Index 45	0.700	6.000	0.570	0.130	-

Periode: 02.05.2023 - 31.07.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
BVG 3 Index 45	0.720	6.000	0.590	0.130	-

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

8 Benchmark

SBI® AAA-BBB Index

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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 im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen 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 Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen

anfallen;

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