

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

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

Halbjahresbericht per 31. Juli 2016

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I.....	30
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	31
Pauschale Verwaltungskommission	31
Benchmark.....	31
TER.....	31
Erklärung der Fussnoten (fehlende Fussnoten für diesen Bericht nicht relevant)	32
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	33

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto.ch zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 26.09.2016

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
 Sitz: **Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich** (von 03.05.2016)
 Europaallee 39, 8004 Zürich (bis 02.05.2016)

Verwaltungsrat

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

Regina Kleeb, Mitglied
 Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement
 Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsführung

Hans Frey
 Geschäftsführer

Markus Erb
 Leiter Legal & Compliance

Andreas Hogg
 stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer (seit 01.03.2016)
 Leiterin Administration & Operations

Bruno Schranz (bis 14.03.2016)
 stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Business Development

André Wirz (bis 01.03.2016)
 Leiter Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
 Sitz: **Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich** (von 03.05.2016)
 Europaallee 39, 8004 Zürich (bis 02.05.2016)

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle:

Zahlstelle ist die Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger:

Mit dem Vertrieb der Teilvermögen ist die Zürcher Kantonalbank,
 Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich beauftragt worden.

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

Übersicht	Rechnungsperiode bis	01.02.2016 31.07.2016	08.07.2015 31.01.2016
Konsolidiert	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'880'420'324.92	1'734'734'101.48
Klasse FA CHF	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		79'889.53	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		801.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.7372	
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	
Klasse NT CHF	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'880'340'435.39	1'734'734'101.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		18'226'718.590	17'134'027.542
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.1640	101.2450
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		95.4570	91.3167
Thesaurierung je Anteil		0.00	0.39348
Total Expense Ratio (TER)		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 / 31.07.2016	2015	2014	2013
Klasse FA CHF (Lancierung 13.07.2016)	-0.27 %	-	-	-
Klasse NT CHF (Lancierung 08.07.2015)	3.75 %	0.20 %	-	-
Benchmark	3.78 %	0.13 %	-	-

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.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.07.2016	31.01.2016
Bankguthaben auf Sicht	7'119'187.90	2'422'646.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'858'057'935.60	1'714'367'149.20
Sonstige Vermögenswerte	15'243'207.68	17'944'306.28
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'880'420'331.18	1'734'734'101.48
Andere Verbindlichkeiten	-6.26	0.00
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'880'420'324.92	1'734'734'101.48

Entwicklung der Anzahl Anteile **Klasse FA CHF** **Rechnungsperiode** Lancierung **13.07.2016**
bis **31.07.2016**

Ausgegebene Anteile	801.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	801.000

Entwicklung der Anzahl Anteile **Klasse NT CHF** **Rechnungsperiode** **01.02.2016** Lancierung **08.07.2015**
bis **31.07.2016** **31.01.2016**

Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	17'134'027.542	0.000
Ausgegebene Anteile	793'188.841	702'370.022
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)	375'892.614	16'604'406.550
Zurückgenommene Anteile	-76'390.407	-134'184.648
Zurückgenommene Anteile (Sachausgaben)	0.000	-38'564.382
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	18'226'718.590	17'134'027.542

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	08.02.2016	38'191'065.48	375'892.614

Veränderung des Nettofondsvermögens **(konsolidiert)** **Rechnungsperiode** **01.02.2016** **08.07.2015**
bis **31.07.2016** **31.01.2016**

Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	1'734'734'101.48	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	-2'465'848.65	-10'831'399.56
Saldo aus dem Anteilverkehr	111'007'174.18	1'692'576'576.29
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung	37'144'897.91	52'988'924.75
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'880'420'324.92	1'734'734'101.48

Erfolgsrechnung (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.02.2016	08.07.2015
	bis	31.07.2016	31.01.2016
Ertrag			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-587.59	-88.25
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		14'453'410.32	16'075'379.82
Sonstige Erträge		3'500.00	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		295'519.55	21'854'103.63
Total Ertrag		14'751'842.28	37'929'395.20
Aufwand			
Reglementarische Vergütung (gemäss separater Tabelle)		-6.26	0.00
Sonstige Aufwendungen		0.00	0.07
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-21'640.30	-240'519.77
Total Aufwand		-21'646.56	-240'519.70
Nettoertrag / Verlust		14'730'195.72	37'688'875.50
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'732'861.34	-1'104'512.82
Einkünfte aus Ausgabekommission/Rücknahmekommission 11)		759'531.49	0.00
Realisierter Erfolg		12'756'865.87	36'584'362.68
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		24'388'032.04	16'404'562.07
Gesamterfolg		37'144'897.91	52'988'924.75

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

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				

Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								1'858'057'935.60	98.81
CH0006448424	4.2500 % SWISS 4 1/4 06/05/17	15'082	0	12'000	3'082	CHF	104.37%	3'216'683.40	0.17
CH0008435569	4.0000 % SWISS 4 02/11/23	16'539	500	0	17'039	CHF	132.26%	22'535'781.40	1.20
CH0008673201	3.7500 % STGALN 3 3/4 04/09/18	400	0	0	400	CHF	107.30%	429'200.00	0.02
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	21'675	500	0	22'175	CHF	153.80%	34'105'150.00	1.80
CH0008805449	0.0000 % IBRD 0 11/26/21	250	250	0	500	CHF	104.05%	520'250.00	0.03
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	820	5'000	0	5'820	CHF	234.35%	13'639'170.00	0.73
CH0013843443	2.8750 % RESFER 2 7/8 02/26/21 E	850	350	0	1'200	CHF	115.70%	1'388'400.00	0.07
CH0015221663	3.0000 % SWISS 3 01/08/18	21'177	2'500	0	23'677	CHF	105.67%	25'019'485.90	1.32
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	13'358	0	0	13'358	CHF	165.13%	22'058'065.40	1.17
CH0017410314	3.2500 % EUROF 3 1/4 12/28/18	1'095	0	0	1'095	CHF	108.95%	1'193'002.50	0.06
CH0017640209	3.1250 % STGALN 3 1/8 02/03/20	180	0	0	180	CHF	112.95%	203'310.00	0.01
CH0017992477	3.0000 % SEK 3 02/27/18 EMTN	2'180	0	0	2'180	CHF	105.65%	2'303'170.00	0.12
CH0018454253	3.0000 % SWISS 3 05/12/19	19'649	1'000	0	20'649	CHF	111.38%	22'998'856.20	1.21
CH0018712346	3.3750 % EUROF 3 3/8 12/29/20	500	0	0	500	CHF	117.00%	585'000.00	0.03
CH0019903365	3.1250 % GE 3 1/8 12/06/19	1'000	0	0	1'000	CHF	111.75%	1'117'500.00	0.06
CH0020372402	2.7500 % OKB 2 3/4 01/28/20	940	0	0	940	CHF	111.95%	1'052'330.00	0.06
CH0020423239	2.5000 % VORHYP 2 1/2 02/15/16	2'500	0	2'500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	100	0	0	100	CHF	140.00%	140'000.00	0.01
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	1'500	0	0	1'500	CHF	125.10%	1'876'500.00	0.10
CH0020616196	2.7500 % KFW 2 3/4 10/11/18 1	700	0	0	700	CHF	107.65%	753'550.00	0.04
CH0020625528	2.5000 % PBBGR 2 1/2 03/09/17 E	820	0	0	820	CHF	101.78%	834'596.00	0.04
CH0020626773	2.7500 % SNCF 2 3/4 01/23/19 EM	950	0	0	950	CHF	108.20%	1'027'900.00	0.05
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	3'480	750	0	4'230	CHF	143.00%	6'048'900.00	0.32
CH0020669583	2.3750 % KA 2 3/8 03/15/17 EMTN	3'250	0	0	3'250	CHF	101.36%	3'294'200.00	0.18
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	3'250	0	0	3'250	CHF	126.60%	4'114'500.00	0.22
CH0020827561	2.5000 % RENTEN 2 1/2 03/05/18	900	0	0	900	CHF	105.05%	945'450.00	0.05
CH0020899941	2.7500 % KWOBER 2 3/4 04/04/17	800	0	0	800	CHF	101.75%	814'000.00	0.04
CH0021247967	2.7500 % EGW 2 3/4 04/30/20 24	1'000	0	0	1'000	CHF	112.15%	1'121'500.00	0.06
CH0021803942	2.3750 % EIB 2 3/8 07/10/20	5'770	0	0	5'770	CHF	112.60%	6'497'020.00	0.35
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMT	5'020	0	0	5'020	CHF	127.25%	6'387'950.00	0.34
CH0021908907	2.2500 % SWISS 2 1/4 07/06/20	17'040	0	0	17'040	CHF	112.98%	19'251'792.00	1.02
CH0022061508	2.3750 % EUROF 2 3/8 08/03/20	2'995	0	0	2'995	CHF	111.45%	3'337'927.50	0.18
CH0022129248	2.2500 % HYN0E 2 1/4 08/02/17	1'030	0	0	1'030	CHF	102.27%	1'053'381.00	0.06
CH0022235607	2.3750 % NEDWBK 2 3/8 08/19/20	1'750	0	0	1'750	CHF	112.20%	1'963'500.00	0.10
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMT	3'450	350	0	3'800	CHF	129.30%	4'913'400.00	0.26
CH0022271362	2.3750 % CFF 2 3/8 08/24/18 EMT	4'220	0	0	4'220	CHF	106.20%	4'481'640.00	0.24
CH0022280058	2.3750 % KA 2 3/8 08/26/20 EMTN	330	0	0	330	CHF	108.25%	357'225.00	0.02
CH0022312109	2.1250 % RENTEN 2 1/8 08/29/17	1'820	0	0	1'820	CHF	103.08%	1'876'056.00	0.10
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'120	0	0	2'120	CHF	123.70%	2'622'440.00	0.14
CH0022595216	2.5000 % BAC 2 1/2 09/28/17 EMT	1'250	0	0	1'250	CHF	102.84%	1'285'500.00	0.07
CH0022653221	2.2500 % EGW 2 1/4 09/19/17 25	260	0	0	260	CHF	103.18%	268'268.00	0.01
CH0022708470	2.1250 % RABOBK 2 1/8 10/11/17	1'700	0	0	1'700	CHF	102.72%	1'746'240.00	0.09
CH0022721762	2.2500 % BNG 2 1/4 10/14/20 EMT	3'190	500	0	3'690	CHF	112.25%	4'142'025.00	0.22
CH0022738105	2.1250 % DEPFA 2 1/8 10/13/17 EM	550	0	550	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0022788647	2.1250 % OKB 2 1/8 10/18/18	450	0	0	450	CHF	106.20%	477'900.00	0.03
CH0022850033	2.0000 % ICO 2 12/15/16 EMTN	540	0	0	540	CHF	100.88%	544'752.00	0.03
CH0022859612	2.0000 % SWISS 2 10/12/16	1'393	0	1'393	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0022862988	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/19/18	3'640	0	0	3'640	CHF	105.71%	3'847'844.00	0.20
CH0023194373	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 11/15/17	4'355	0	0	4'355	CHF	103.75%	4'518'312.50	0.24

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0023266841	2.6250 % KBLUZE 2 5/8 11/25/20	780	0	0	780	CHF	112.80%	879'840.00	0.05
CH0023438010	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 12/13/19	3'355	0	0	3'355	CHF	109.96%	3'689'158.00	0.20
CH0023710160	2.3750 % EGW 2 3/8 01/12/18 27	1'370	0	0	1'370	CHF	104.70%	1'434'390.00	0.08
CH0023960328	2.3750 % NEDWBK 2 3/8 01/27/23	1'120	0	0	1'120	CHF	119.60%	1'339'520.00	0.07
CH0023970400	2.5000 % ITALY 2 1/2 01/30/18 EM	2'710	0	0	2'710	CHF	104.20%	2'823'820.00	0.15
CH0023972752	2.5000 % GE 2 1/2 02/08/18	1'505	0	0	1'505	CHF	104.30%	1'569'715.00	0.08
CH0023991182	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/27/21	5'440	0	0	5'440	CHF	112.64%	6'127'616.00	0.33
CH0023991331	2.3750 % VORHYP 2 3/8 08/09/17	420	0	0	420	CHF	102.58%	430'836.00	0.02
CH0024021302	2.3750 % DEPFA 2 3/8 02/15/19 EM	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0024117704	2.6250 % PSPNSW 2 5/8 02/16/16	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMT	580	0	0	580	CHF	139.50%	809'100.00	0.04
CH0024151414	2.2500 % NRW 2 1/4 03/01/19 EMT		500	0	500	CHF	107.45%	537'250.00	0.03
CH0024318724	2.5000 % DHY 2 1/2 03/08/18 EMT	150	0	0	150	CHF	104.30%	156'450.00	0.01
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	1'660	0	0	1'660	CHF	147.45%	2'447'670.00	0.13
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	800	0	0	800	CHF	125.75%	1'006'000.00	0.05
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	12'692	500	0	13'192	CHF	154.57%	20'390'874.40	1.08
CH0024674944	2.5000 % KBBS 2 1/2 03/24/21	1'670	0	0	1'670	CHF	113.05%	1'887'935.00	0.10
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	4'400	0	0	4'400	CHF	131.85%	5'801'400.00	0.31
CH0025368751	3.0000 % LLOYDS 3 05/26/16 EMT	280	0	280	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0025580439	3.2500 % BAC 3 1/4 06/14/16 EMT	360	0	360	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0025633717	3.3750 % GE 3 3/8 06/19/18	1'980	0	0	1'980	CHF	107.10%	2'120'580.00	0.11
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	116.65%	1'166'500.00	0.06
CH0025739316	3.1250 % TOTAL 3 1/8 06/28/18	2'845	0	0	2'845	CHF	106.35%	3'025'657.50	0.16
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 E		300	0	300	CHF	154.55%	463'650.00	0.02
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	166.50%	2'997'000.00	0.16
CH0025915056	3.0000 % PSHYPO 3 06/27/17 403	750	0	750	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0025978716	3.2500 % HSBC 3 1/4 07/14/16 EM	680	0	680	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EM	960	0	0	960	CHF	127.65%	1'225'440.00	0.07
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36		320	0	320	CHF	166.75%	533'600.00	0.03
CH0026302304	3.3750 % ABNAV 3 3/8 08/15/31	1'800	0	0	1'800	CHF	152.50%	2'745'000.00	0.15
CH0026424041	3.1250 % PSHYPO 3 1/8 08/15/18	2'400	0	0	2'400	CHF	107.32%	2'575'680.00	0.14
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	2'540	0	0	2'540	CHF	131.55%	3'341'370.00	0.18
CH0026791225	3.1250 % C 3 1/8 09/27/21 EMTN	1'360	500	0	1'860	CHF	115.30%	2'144'580.00	0.11
CH0026950078	2.7500 % UKRAIL 2 3/4 10/06/21 E	1'100	0	0	1'100	CHF	118.05%	1'298'550.00	0.07
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31	1'560	250	0	1'810	CHF	147.50%	2'669'750.00	0.14
CH0026985561	2.6250 % KOMMUN 2 5/8 10/17/16	630	0	0	630	CHF	100.69%	634'347.00	0.03
CH0027015038	2.7500 % PFZENT 2 3/4 10/02/18 3	1'800	0	0	1'800	CHF	107.16%	1'928'880.00	0.10
CH0027073219	2.7500 % BRADBI 2 3/4 10/16/18 E	350	0	350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0027188611	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 10/16/20	2'560	0	0	2'560	CHF	113.60%	2'908'160.00	0.15
CH0027333241	2.6250 % RATFPF 2 5/8 11/06/19 E	1'470	0	0	1'470	CHF	110.30%	1'621'410.00	0.09
CH0027376992	2.6250 % HYN0E 2 5/8 02/07/17	1'730	0	0	1'730	CHF	101.51%	1'756'123.00	0.09
CH0027539151	3.1250 % MS 3 1/8 11/21/18 EMTN	1'680	0	0	1'680	CHF	108.05%	1'815'240.00	0.10
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	2'980	0	0	2'980	CHF	126.75%	3'777'150.00	0.20
CH0027811394	2.5000 % PFZENT 2 1/2 11/27/16 3	2'530	0	2'530	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0027815288	2.6250 % SNCF 2 5/8 12/13/21 EM	1'410	1'000	0	2'410	CHF	115.70%	2'788'370.00	0.15
CH0027866240	2.6250 % STATNE 2 5/8 12/15/17	550	0	0	550	CHF	103.90%	571'450.00	0.03
CH0027886453	2.5000 % OBLB 2 1/2 06/20/17 EM	1'000	0	0	1'000	CHF	102.30%	1'023'000.00	0.05
CH0027972139	2.5000 % SGKNSW 2 1/2 12/12/18	780	0	0	780	CHF	106.80%	833'040.00	0.04
CH0027982179	2.5000 % NEDWBK 2 1/2 12/27/18	2'490	0	0	2'490	CHF	107.60%	2'679'240.00	0.14
CH0027984514	2.6250 % Q 2 5/8 06/21/17 EMTN	3'610	0	3'610	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0028577036	2.6250 % SEK 2 5/8 02/09/17 EMT	1'550	0	1'550	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0028608195	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 02/07/22	2'870	0	0	2'870	CHF	118.80%	3'409'560.00	0.18
CH0028608856	2.5000 % EIB 2 1/2 02/08/19 EMTN	3'645	0	0	3'645	CHF	108.20%	3'943'890.00	0.21
CH0028644646	2.6250 % NESNVX 2 5/8 02/14/18	570	0	0	570	CHF	104.70%	596'790.00	0.03

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0028645254	2.6250 % BNG 2 5/8 02/09/17 EMT	1'760	0	1'760	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0028785654	2.8750 % HYN0E 2 7/8 02/22/16	250	0	250	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0028944681	2.8750 % GE 2 7/8 02/27/17	400	0	0	400	CHF	101.86%	407'440.00	0.02
CH0028945605	3.1250 % LHN0X 3 1/8 02/20/17	1'540	0	1'000	540	CHF	101.87%	550'098.00	0.03
CH0028968201	2.8750 % PSHYPO 2 7/8 02/14/22	2'230	0	0	2'230	CHF	118.07%	2'632'961.00	0.14
CH0029298426	2.7500 % PFZENT 2 3/4 02/28/17 3	1'860	0	0	1'860	CHF	102.03%	1'897'758.00	0.10
CH0029365100	3.0000 % C 3 03/21/19 EMTN		500	0	500	CHF	107.90%	539'500.00	0.03
CH0029450126	2.8750 % PSHYPO 2 7/8 03/15/19	2'650	0	0	2'650	CHF	108.77%	2'882'405.00	0.15
CH0029630131	2.7500 % HSBC 2 3/4 04/03/17 EM	200	0	0	200	CHF	102.14%	204'280.00	0.01
CH0030150079	2.7500 % BERGER 2 3/4 05/03/17	1'500	0	0	1'500	CHF	102.54%	1'538'100.00	0.08
CH0030356718	3.0000 % BKWSW 3 04/27/22	500	0	0	500	CHF	115.35%	576'750.00	0.03
CH0030644030	3.2500 % POLAND 3 1/4 05/15/19	2'840	1'000	0	3'840	CHF	109.80%	4'216'320.00	0.22
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	2'810	500	0	3'310	CHF	125.70%	4'160'670.00	0.22
CH0030876111	3.0000 % CFF 3 06/07/22 EMTN	1'290	0	0	1'290	CHF	120.55%	1'555'095.00	0.08
CH0030983685	3.0000 % BPLN 3 06/14/17 EMTN	470	0	0	470	CHF	103.00%	484'100.00	0.03
CH0030985599	3.0000 % HSHN 3 06/14/19 EMTN	500	0	0	500	CHF	108.00%	540'000.00	0.03
CH0031084087	3.0000 % ZURCTY 3 06/08/22	1'100	0	0	1'100	CHF	119.90%	1'318'900.00	0.07
CH0031102061	3.0000 % OKB 3 06/14/22	1'630	0	0	1'630	CHF	121.50%	1'980'450.00	0.11
CH0031212100	3.0000 % BQTESS 3 06/15/17	280	0	0	280	CHF	102.88%	288'064.00	0.02
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27	400	300	0	700	CHF	136.21%	953'470.00	0.05
CH0031280875	3.1250 % BYLAN 3 1/8 06/27/18 EM	200	0	0	200	CHF	106.40%	212'800.00	0.01
CH0031388124	3.1250 % BNG 3 1/8 07/02/18 EMT	3'880	0	0	3'880	CHF	107.35%	4'165'180.00	0.22
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	150	0	0	150	CHF	123.25%	184'875.00	0.01
CH0031442731	3.2500 % KBBS 3 1/4 06/29/22	2'300	0	0	2'300	CHF	120.55%	2'772'650.00	0.15
CH0031823823	3.1250 % BERN 3 1/8 06/27/19	3'710	0	0	3'710	CHF	110.70%	4'106'970.00	0.22
CH0031835439	3.2500 % BUNIMM 3 1/4 07/16/19	820	500	0	1'320	CHF	111.05%	1'465'860.00	0.08
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	9'050	0	0	9'050	CHF	142.25%	12'873'625.00	0.68
CH0031901066	3.5000 % SGKNSW 3 1/2 07/27/17	3'980	0	0	3'980	CHF	104.06%	4'141'588.00	0.22
CH0032254739	3.7500 % SCMN0X 3 3/4 07/19/17	1'510	0	1'000	510	CHF	104.15%	531'165.00	0.03
CH0032508563	3.5000 % CAFFIL 3 1/2 08/09/17	800	0	0	800	CHF	104.06%	832'480.00	0.04
CH0032637719	2.5000 % NIB 2 1/2 04/11/18 EMTN	700	0	0	700	CHF	105.25%	736'750.00	0.04
CH0032736164	3.5000 % ACHMEA 3 1/2 08/22/17	300	0	0	300	CHF	104.22%	312'660.00	0.02
CH0032897628	3.3750 % KFW 3 3/8 08/30/17	1'360	0	0	1'360	CHF	104.51%	1'421'336.00	0.08
CH0033023216	3.5000 % CAFFIL 3 1/2 08/28/19	870	0	0	870	CHF	112.85%	981'795.00	0.05
CH0033037679	3.5000 % RABOBK 3 1/2 08/31/23	1'900	0	0	1'900	CHF	124.15%	2'358'850.00	0.13
CH0033470748	3.2500 % PFZENT 3 1/4 09/10/19 3	1'800	0	0	1'800	CHF	111.61%	2'008'980.00	0.11
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	2'720	0	0	2'720	CHF	143.15%	3'893'680.00	0.21
CH0033902419	3.2500 % RATFPF 3 1/4 10/09/17 E	500	0	0	500	CHF	104.32%	521'600.00	0.03
CH0033961746	3.3750 % PSHYPO 3 3/8 10/10/22	2'210	0	0	2'210	CHF	123.30%	2'724'930.00	0.14
CH0034493137	3.2500 % CDCEPS 3 1/4 11/13/17	200	0	0	200	CHF	104.91%	209'820.00	0.01
CH0035031340	3.2500 % IDF 3 1/4 11/27/18 EMTN	2'270	0	0	2'270	CHF	108.85%	2'470'895.00	0.13
CH0035613691	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 12/12/18	3'050	0	0	3'050	CHF	108.81%	3'318'705.00	0.18
CH0035678728	3.0000 % KBBL 3 12/14/17 1	1'000	0	0	1'000	CHF	104.79%	1'047'900.00	0.06
CH0036172101	4.0000 % EDF 4 03/27/17 2	1'580	0	0	1'580	CHF	102.71%	1'622'818.00	0.09
CH0036702964	3.2500 % KTBS 3 1/4 01/31/20	1'100	0	0	1'100	CHF	113.30%	1'246'300.00	0.07
CH0037204515	3.0000 % PFZENT 3 02/15/18 386	1'380	0	0	1'380	CHF	105.42%	1'454'796.00	0.08
CH0037972392	4.8750 % CS 4 7/8 03/14/18 EMTN	2'205	0	0	2'205	CHF	106.45%	2'347'222.50	0.12
CH0038261068	3.1250 % ZURCTY 3 1/8 03/27/17	810	0	810	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0039139263	4.5000 % ROSW 4 1/2 03/23/17	4'040	0	2'000	2'040	CHF	103.31%	2'107'524.00	0.11
CH0039139404	2.8750 % ZURCTY 2 7/8 04/21/21	1'815	0	0	1'815	CHF	115.30%	2'092'695.00	0.11
CH0039165268	3.2500 % EIB 3 1/4 04/30/18 EMTN	2'805	0	0	2'805	CHF	106.85%	2'997'142.50	0.16
CH0039193450	3.2500 % KOMMUN 3 1/4 05/08/18	700	0	0	700	CHF	106.90%	748'300.00	0.04
CH0039266512	3.3750 % COE 3 3/8 11/06/20 EMT	570	0	0	570	CHF	117.90%	672'030.00	0.04
CH0039480675	3.2500 % HESSEN 3 1/4 05/22/17	600	0	0	600	CHF	103.11%	618'660.00	0.03

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0039621724	3.3750 % Q 3 3/8 01/19/18 EMTN	1'150	0	0	1'150	CHF	105.75%	1'216'125.00	0.06
CH0042390242	3.3750 % KWLILI 3 3/8 06/06/16	300	0	300	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0042451382	4.1250 % BNFP 4 1/8 06/20/16 EM	475	0	475	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0042899630	3.5000 % PFZENT 3 1/2 06/21/18 3	1'560	0	0	1'560	CHF	107.43%	1'675'908.00	0.09
CH0043140794	3.6250 % CDCEPS 3 5/8 04/16/18	900	0	0	900	CHF	107.05%	963'450.00	0.05
CH0043595203	3.7500 % ONT 3 3/4 07/30/18 EMT	2'350	0	0	2'350	CHF	108.60%	2'552'100.00	0.14
CH0043918413	3.5000 % ZURCTY 3 1/2 08/14/20	1'365	0	0	1'365	CHF	115.70%	1'579'305.00	0.08
CH0044004684	3.5000 % KBAARG 3 1/2 08/14/17	1'020	0	0	1'020	CHF	104.22%	1'063'044.00	0.06
CH0044200993	3.3750 % RATFPF 3 3/8 03/21/16 E	470	0	470	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0045259980	3.1250 % PFZENT 3 1/8 09/15/17 3	500	0	0	500	CHF	104.23%	521'150.00	0.03
CH0045490817	4.5000 % GE 4 1/2 10/09/18 EMTN	2'760	0	0	2'760	CHF	110.40%	3'047'040.00	0.16
CH0046229917	3.8750 % ALPHSW 3 7/8 10/30/18	1'010	0	0	1'010	CHF	105.55%	1'066'055.00	0.06
CH0046254477	3.2500 % VDP 3 1/4 11/05/18 EMT	570	0	0	570	CHF	108.65%	619'305.00	0.03
CH0048758525	2.8750 % BRCOL 2 7/8 12/27/17 E	450	0	0	450	CHF	104.90%	472'050.00	0.03
CH0049484618	3.8750 % Q 3 7/8 12/11/18 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	110.65%	2'378'975.00	0.13
CH0049727685	4.0000 % ALPHSW 4 02/10/17	820	0	820	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0049836759	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/20/19	500	0	0	500	CHF	108.10%	540'500.00	0.03
CH0049874594	2.6250 % PFZENT 2 5/8 02/08/19 3	1'250	0	0	1'250	CHF	107.84%	1'348'000.00	0.07
CH0100128385	2.7500 % IBRD 2 3/4 05/07/19 EMT	900	0	0	900	CHF	109.60%	986'400.00	0.05
CH0100345682	2.8750 % BRCOL 2 7/8 11/27/18 E	780	0	0	780	CHF	108.30%	844'740.00	0.04
CH0100484697	2.6250 % BIENNE 2 5/8 04/12/19	150	0	0	150	CHF	107.85%	161'775.00	0.01
CH0100524187	2.6250 % BERN 2 5/8 04/24/20	1'395	0	0	1'395	CHF	111.90%	1'561'005.00	0.08
CH0100525382	3.0000 % CADES 3 04/21/21 EMTN		1'000	0	1'000	CHF	117.05%	1'170'500.00	0.06
CH0100683017	2.7500 % IADB 2 3/4 04/15/19 EMT	1'550	0	0	1'550	CHF	109.35%	1'694'925.00	0.09
CH0101032537	3.3750 % ONT 3 3/8 04/29/19 EMT	500	0	0	500	CHF	111.05%	555'250.00	0.03
CH0101526678	2.6250 % AFDB 2 5/8 03/25/19 EM	1'235	0	0	1'235	CHF	108.35%	1'338'122.50	0.07
CH0101589353	3.6250 % RABOBK 3 5/8 07/02/19	1'410	0	0	1'410	CHF	111.10%	1'566'510.00	0.08
CH0101768064	2.7500 % SNCF 2 3/4 06/11/18 EM	800	0	0	800	CHF	105.90%	847'200.00	0.05
CH0102307383	2.6250 % EDC 2 5/8 07/24/17 EMT	1'230	0	0	1'230	CHF	103.09%	1'268'007.00	0.07
CH0103078231	3.0000 % RESFER 3 04/24/19 EMT	900	0	0	900	CHF	109.45%	985'050.00	0.05
CH0103164577	3.3750 % BKWSW 3 3/8 07/29/19	1'970	0	0	1'970	CHF	109.50%	2'157'150.00	0.11
CH0103165012	2.5000 % TESSIN 2 1/2 11/04/21		700	0	700	CHF	115.40%	807'800.00	0.04
CH0103165020	3.0000 % ALPHSW 3 11/25/19	520	0	0	520	CHF	103.80%	539'760.00	0.03
CH0103165046	2.1250 % EUROF 2 1/8 11/10/17	1'055	0	0	1'055	CHF	103.36%	1'090'448.00	0.06
CH0104493058	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 09/10/18 1	1'500	0	0	1'500	CHF	106.00%	1'590'000.00	0.08
CH0104691628	3.2500 % SCMNIX 3 1/4 09/14/18	4'500	0	0	4'500	CHF	107.50%	4'837'500.00	0.26
CH0104760001	2.3750 % KBLUZE 2 3/8 09/10/18	500	0	0	500	CHF	105.90%	529'500.00	0.03
CH0105134891	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/15/17 3	1'030	0	0	1'030	CHF	103.09%	1'061'827.00	0.06
CH0105134925	2.6250 % PFZENT 2 5/8 09/16/21 3	1'000	0	0	1'000	CHF	115.45%	1'154'500.00	0.06
CH0105202995	4.0000 % LHNIX 4 09/11/18 EMTN	1'880	0	0	1'880	CHF	108.55%	2'040'740.00	0.11
CH0105335498	2.2500 % ICO 2 1/4 11/07/17 EMTN	970	0	0	970	CHF	103.30%	1'002'010.00	0.05
CH0105376641	2.5000 % BNG 2 1/2 10/14/19 EMT	600	0	0	600	CHF	110.25%	661'500.00	0.04
CH0105994203	2.5000 % CAFFIL 2 1/2 05/02/18	3'620	0	0	3'620	CHF	105.45%	3'817'290.00	0.20
CH0106013607	2.3750 % DANBNK 2 3/8 01/13/17	1'120	0	0	1'120	CHF	101.36%	1'135'232.00	0.06
CH0106596916	3.0000 % CBAU 3 11/09/17 EMTN	2'230	0	0	2'230	CHF	104.24%	2'324'552.00	0.12
CH0106848440	2.5000 % GENEVA 2 1/2 11/27/19	500	0	0	500	CHF	109.85%	549'250.00	0.03
CH0106942508	2.3750 % SNCF 2 3/8 07/24/19 EM	370	0	0	370	CHF	108.75%	402'375.00	0.02
CH0107012129	2.5000 % BERN 2 1/2 11/26/21	500	0	0	500	CHF	116.25%	581'250.00	0.03
CH0107134568	2.7500 % LGT 2 3/4 12/08/16	430	0	0	430	CHF	101.19%	435'117.00	0.02
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	1'950	0	0	1'950	CHF	127.50%	2'486'250.00	0.13
CH0107134717	2.2500 % KFW 2 1/4 08/12/20	550	0	0	550	CHF	112.85%	620'675.00	0.03
CH0107212968	2.5000 % ONT 2 1/2 12/04/19 EMT	1'045	0	0	1'045	CHF	110.50%	1'154'725.00	0.06
CH0107326982	2.1250 % SBAB 2 1/8 06/08/16 EM	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0107559392	2.8750 % Q 2 7/8 12/17/21 EMTN	860	0	0	860	CHF	119.00%	1'023'400.00	0.05

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0107685445	2.5000 % KBBL 2 1/2 12/16/19	650	0	0	650	CHF	109.55%	712'075.00	0.04
CH0107746130	3.1250 % WSTP 3 1/8 12/21/18 EM	800	0	0	800	CHF	107.80%	862'400.00	0.05
CH0107991892	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 01/07/22 1	300	1'000	0	1'300	CHF	115.00%	1'495'000.00	0.08
CH0108071116	2.1250 % ZUGKAN 2 1/8 12/22/17	960	0	0	960	CHF	103.60%	994'560.00	0.05
CH0108734846	2.1250 % ZKB 2 1/8 02/05/18 109	1'840	0	0	1'840	CHF	103.80%	1'909'920.00	0.10
CH0108785053	2.5000 % ADPFP 2 1/2 01/27/17	1'370	0	1'370	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0108785608	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 10/30/19	1'490	0	0	1'490	CHF	109.17%	1'626'633.00	0.09
CH0108792059	2.0000 % NEDWBK 2 10/10/17 EM	300	0	0	300	CHF	103.12%	309'360.00	0.02
CH0109117579	2.1250 % SBAB 2 1/8 02/15/17 EM	1'030	0	0	1'030	CHF	101.42%	1'044'626.00	0.06
CH0109152741	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 06/10/20	500	0	0	500	CHF	109.65%	548'250.00	0.03
CH0109153160	3.0000 % LONNVX 3 06/02/16	1'610	0	1'610	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0109156130	2.5000 % WSTP 2 1/2 02/16/17 EM	2'810	0	2'810	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMT	1'300	0	0	1'300	CHF	141.80%	1'843'400.00	0.10
CH0109361821	1.8750 % SEK 1 7/8 03/08/17 EMT	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0109411238	2.3750 % BNG 2 3/8 11/19/19 EMT	1'030	0	0	1'030	CHF	110.10%	1'134'030.00	0.06
CH0109559580	2.0000 % PFZENT 2 02/09/18 399	3'420	0	0	3'420	CHF	103.93%	3'554'406.00	0.19
CH0109674470	2.6250 % AXPOSW 2 5/8 02/26/20	4'070	0	2'900	1'170	CHF	107.55%	1'258'335.00	0.07
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	500	500	0	1'000	CHF	111.00%	1'110'000.00	0.06
CH0109736824	2.3750 % CIFEUR 2 3/8 03/05/19	1'210	0	0	1'210	CHF	107.40%	1'299'540.00	0.07
CH0109889128	2.1250 % STAAKA 2 1/8 07/04/18	850	0	0	850	CHF	105.25%	894'625.00	0.05
CH0109987112	2.2500 % NEDWBK 2 1/4 09/03/19	500	0	0	500	CHF	108.95%	544'750.00	0.03
CH0110118566	2.1250 % KWLILI 2 1/8 03/10/17	1'035	0	0	1'035	CHF	101.25%	1'047'937.50	0.06
CH0110335871	2.1250 % NIEDOE 2 1/8 08/15/17	620	0	0	620	CHF	102.75%	637'050.00	0.03
CH0110346225	2.1250 % EIB 2 1/8 01/22/20	1'620	0	0	1'620	CHF	110.00%	1'782'000.00	0.09
CH0110442859	3.3750 % CS 3 3/8 03/16/20 EMTN	1'060	0	0	1'060	CHF	109.20%	1'157'520.00	0.06
CH0110493225	2.3750 % BERN 2 3/8 03/25/22	700	0	0	700	CHF	116.30%	814'100.00	0.04
CH0110680680	2.0000 % KKWLEB 2 03/29/16	430	0	430	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0110680714	2.5000 % KKWLEB 2 1/2 03/29/19	950	0	0	950	CHF	105.60%	1'003'200.00	0.05
CH0110699987	2.0000 % SHBASS 2 12/01/16 EMT	510	0	0	510	CHF	100.89%	514'539.00	0.03
CH0110741086	1.7500 % EIB 1 3/4 04/21/17	1'400	0	1'400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0110798540	1.7500 % KUNTA 1 3/4 05/26/17 E	250	0	0	250	CHF	101.97%	254'925.00	0.01
CH0111007206	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 02/25/20	4'700	0	0	4'700	CHF	109.65%	5'153'550.00	0.27
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30	600	500	0	1'100	CHF	135.61%	1'491'710.00	0.08
CH0111174576	2.2500 % EDF 2 1/4 09/29/17	1'200	0	0	1'200	CHF	102.83%	1'233'960.00	0.07
CH0111191133	2.5000 % GENEVA 2 1/2 04/06/22	250	0	0	250	CHF	117.00%	292'500.00	0.02
CH0111825805	1.7500 % PFZENT 1 3/4 04/12/17 4	840	0	0	840	CHF	101.70%	854'280.00	0.05
CH0111999816	2.0000 % SWISS 2 04/28/21	16'794	1'000	0	17'794	CHF	114.18%	20'317'189.20	1.08
CH0112086951	2.1250 % BNG 2 1/8 11/06/18 EMT	1'130	0	0	1'130	CHF	106.50%	1'203'450.00	0.06
CH0112089971	3.3750 % GEOFIS 3 3/8 05/12/16	900	0	900	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0112120537	2.5000 % LGT 2 1/2 05/12/17	1'160	0	0	1'160	CHF	102.42%	1'188'072.00	0.06
CH0112138794	2.3750 % ONT 2 3/8 05/07/20 EMT	1'180	0	0	1'180	CHF	111.45%	1'315'110.00	0.07
CH0112193518	3.1250 % IMPNSW 3 1/8 05/12/16	570	0	570	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0112262933	2.1250 % EBN 2 1/8 04/27/20 1	1'530	0	0	1'530	CHF	109.50%	1'675'350.00	0.09
CH0112263006	1.6250 % IDF 1 5/8 12/08/17 EMTN	700	0	0	700	CHF	102.94%	720'580.00	0.04
CH0112272783	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/12/20 111	1'000	0	0	1'000	CHF	108.90%	1'089'000.00	0.06
CH0112403875	2.2500 % SGKNSW 2 1/4 05/11/20	400	0	0	400	CHF	109.70%	438'800.00	0.02
CH0112734469	2.5000 % VBPSW 2 1/2 05/27/16	450	0	450	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0112933483	2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23	1'000	0	0	1'000	CHF	118.35%	1'183'500.00	0.06
CH0112933756	1.8750 % KTBS 1 7/8 05/31/19	1'600	0	0	1'600	CHF	107.05%	1'712'800.00	0.09
CH0113480161	2.1250 % GENEVA 2 1/8 06/15/20	1'400	0	0	1'400	CHF	110.15%	1'542'100.00	0.08
CH0113678400	1.7500 % KBBL 1 3/4 06/25/19	950	0	0	950	CHF	105.95%	1'006'525.00	0.05
CH0113872284	1.7500 % CM 1 3/4 06/30/17 EMTN	1'790	0	1'000	790	CHF	102.05%	806'195.00	0.04
CH0113982562	2.1250 % ZKB 2 1/8 06/29/22 113	2'530	0	0	2'530	CHF	114.30%	2'891'790.00	0.15
CH0113987033	2.3750 % CS 2 3/8 06/21/17 MTN	550	0	550	0	CHF	0.00%	0.00	0.00

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0114150888	2.0000 % COOPSW 2 06/30/16	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0114260257	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 06/28/23	4'280	0	0	4'280	CHF	116.72%	4'995'616.00	0.27
CH0114261446	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 06/30/20	2'050	0	0	2'050	CHF	108.70%	2'228'350.00	0.12
CH0114511428	2.2500 % NAB 2 1/4 07/14/17 EMT	1'050	0	0	1'050	CHF	102.45%	1'075'725.00	0.06
CH0114634493	2.0000 % CFF 2 12/20/17 EMTN	2'360	0	0	2'360	CHF	103.46%	2'441'656.00	0.13
CH0114695379	2.6250 % SCMNVX 2 5/8 08/31/22	2'195	0	0	2'195	CHF	116.85%	2'564'857.50	0.14
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	1'250	0	0	1'250	CHF	118.65%	1'483'125.00	0.08
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	1'300	0	0	1'300	CHF	126.65%	1'646'450.00	0.09
CH0114839266	2.3750 % KWHINT 2 3/8 07/28/22	280	0	0	280	CHF	111.60%	312'480.00	0.02
CH0115013226	1.8750 % NEDWBK 1 7/8 02/03/20	1'900	0	0	1'900	CHF	109.40%	2'078'600.00	0.11
CH0115108109	2.0000 % CIFEUR 2 01/30/19 EMT	200	0	0	200	CHF	106.40%	212'800.00	0.01
CH0115357466	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/08/16	3'090	0	3'090	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0115457670	2.0000 % RABOBK 2 09/16/21 EMT	1'940	1'000	0	2'940	CHF	110.55%	3'250'170.00	0.17
CH0115595487	2.0000 % EIB 2 08/24/22 EMTN	3'150	0	0	3'150	CHF	116.45%	3'668'175.00	0.20
CH0115967389	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 05/13/20	1'730	0	0	1'730	CHF	108.76%	1'881'548.00	0.10
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32	2'050	0	0	2'050	CHF	134.75%	2'762'375.00	0.15
CH0116103489	1.7500 % ACACB 1 3/4 07/27/17 E	2'650	0	0	2'650	CHF	102.37%	2'712'805.00	0.14
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	1'580	0	0	1'580	CHF	119.00%	1'880'200.00	0.10
CH0116492213	1.2500 % THURBK 1 1/4 09/15/17	1'000	0	0	1'000	CHF	101.97%	1'019'700.00	0.05
CH0116706752	1.5000 % PFZENT 1 1/2 09/03/20 4	2'500	0	0	2'500	CHF	107.99%	2'699'750.00	0.14
CH0116712636	1.3750 % RAIFFS 1 3/8 09/21/17	600	0	0	600	CHF	101.86%	611'160.00	0.03
CH0117076155	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 05/22/18	1'360	0	0	1'360	CHF	103.34%	1'405'424.00	0.07
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31	2'890	0	0	2'890	CHF	127.33%	3'679'837.00	0.20
CH0117441565	3.0000 % BAC 3 12/23/16 EMTN	600	0	0	600	CHF	101.35%	608'100.00	0.03
CH0117606472	2.0000 % MIGROS 2 05/03/17	510	0	0	510	CHF	101.93%	519'843.00	0.03
CH0117615143	1.8750 % ZUGKAN 1 7/8 10/14/20	900	0	0	900	CHF	109.25%	983'250.00	0.05
CH0117615374	2.2500 % CFF 2 1/4 10/13/21 EMT	2'190	0	0	2'190	CHF	114.75%	2'513'025.00	0.13
CH0117683794	2.8750 % BALHOL 2 7/8 10/14/20	500	0	0	500	CHF	111.85%	559'250.00	0.03
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	1'330	0	0	1'330	CHF	115.70%	1'538'810.00	0.08
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	100	0	0	100	CHF	119.35%	119'350.00	0.01
CH0118173803	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 10/18/17	2'200	0	0	2'200	CHF	102.55%	2'256'100.00	0.12
CH0118173829	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 08/03/20	2'400	0	0	2'400	CHF	108.26%	2'598'240.00	0.14
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29	1'280	0	0	1'280	CHF	127.50%	1'632'000.00	0.09
CH0118532834	2.0000 % RABOBK 2 01/31/18 EMT	900	0	0	900	CHF	103.50%	931'500.00	0.05
CH0118607909	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/09/20	500	0	0	500	CHF	108.75%	543'750.00	0.03
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMT		900	0	900	CHF	131.70%	1'185'300.00	0.06
CH0118882353	1.3750 % NORSTA 1 3/8 11/15/17	830	0	0	830	CHF	102.28%	848'924.00	0.05
CH0119015060	1.7500 % PFZENT 1 3/4 11/01/19 4	1'820	0	0	1'820	CHF	107.18%	1'950'676.00	0.10
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	2'175	0	0	2'175	CHF	119.55%	2'600'212.50	0.14
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	750	0	0	750	CHF	136.40%	1'023'000.00	0.05
CH0119533278	3.1250 % CS 3 1/8 11/12/30 EMTN	765	0	0	765	CHF	125.40%	959'310.00	0.05
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'540	0	0	2'540	CHF	134.45%	3'415'030.00	0.18
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	1'565	0	0	1'565	CHF	127.95%	2'002'417.50	0.11
CH0120096398	1.7500 % DBHNGR 1 3/4 06/03/20	3'950	0	0	3'950	CHF	109.10%	4'309'450.00	0.23
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28	500	500	0	1'000	CHF	126.53%	1'265'300.00	0.07
CH0120401325	1.8750 % INTNED 1 7/8 08/29/18 E	850	0	0	850	CHF	105.00%	892'500.00	0.05
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	730	0	0	730	CHF	140.15%	1'023'095.00	0.05
CH0120743346	2.0000 % HSBC 2 04/23/19 EMTN	1'980	0	0	1'980	CHF	106.85%	2'115'630.00	0.11
CH0122456756	2.0000 % ZKB 2 01/21/21 117	1'040	0	0	1'040	CHF	110.40%	1'148'160.00	0.06
CH0122487488	2.5000 % ALLNSW 2 1/2 05/12/16	400	0	400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0122488411	2.3750 % GRANDX 2 3/8 06/10/21	310	0	0	310	CHF	106.65%	330'615.00	0.02
CH0122489096	2.2500 % GE 2 1/4 12/19/16	1'620	0	1'620	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0122489104	2.3750 % ABNANV 2 3/8 02/02/16	600	0	600	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0122489153	2.0000 % SBAB 2 02/17/16 EMTN	780	0	780	0	CHF	0.00%	0.00	0.00

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	1'860	0	0	1'860	CHF	126.15%	2'346'390.00	0.12
CH0122526608	2.6250 % ENAG 2 5/8 01/31/23	580	0	0	580	CHF	107.55%	623'790.00	0.03
CH0122758615	1.8750 % DNBNO 1 7/8 02/02/16 E	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0122787564	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/25/20	2'070	0	0	2'070	CHF	111.25%	2'302'875.00	0.12
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24	1'890	0	0	1'890	CHF	119.73%	2'262'897.00	0.12
CH0122951673	2.3750 % BNPPCB 2 3/8 10/07/20	620	0	0	620	CHF	111.90%	693'780.00	0.04
CH0122956177	1.6250 % KUNTA 1 5/8 02/07/18 E	1'200	0	0	1'200	CHF	103.35%	1'240'200.00	0.07
CH0123133297	3.0000 % FGBUH 3 02/16/16	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0123385756	2.2500 % SNCF 2 1/4 02/25/21 EM	200	0	0	200	CHF	111.75%	223'500.00	0.01
CH0123555424	2.2500 % ABNAV 2 1/4 07/10/18	500	0	0	500	CHF	105.50%	527'500.00	0.03
CH0123575091	2.1250 % NORSTA 2 1/8 02/14/20	2'330	0	0	2'330	CHF	109.00%	2'539'700.00	0.14
CH0123590991	2.2500 % GENEVA 2 1/4 02/22/21	500	0	0	500	CHF	112.45%	562'250.00	0.03
CH0123918424	2.2500 % STAAKA 2 1/4 02/22/21	500	0	0	500	CHF	112.75%	563'750.00	0.03
CH0124071959	2.2500 % BNG 2 1/4 02/23/21 EMT	1'200	0	0	1'200	CHF	113.20%	1'358'400.00	0.07
CH0124131001	2.2500 % THURBK 2 1/4 02/25/21	490	0	0	490	CHF	111.60%	546'840.00	0.03
CH0124138816	2.0000 % PSHYPO 2 09/27/19 543	740	0	0	740	CHF	107.71%	797'054.00	0.04
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27	3'510	0	0	3'510	CHF	127.39%	4'471'389.00	0.24
CH0124205532	2.2500 % NEDWBK 2 1/4 02/24/21	2'040	0	0	2'040	CHF	113.15%	2'308'260.00	0.12
CH0124295756	1.5000 % OKB 1 1/2 02/23/16	380	0	380	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0124295764	2.1250 % OKB 2 1/8 07/23/19	1'620	0	0	1'620	CHF	108.30%	1'754'460.00	0.09
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31	1'190	0	0	1'190	CHF	137.30%	1'633'870.00	0.09
CH0124470904	2.1250 % KOMMUN 2 1/8 10/09/20	1'520	0	0	1'520	CHF	111.55%	1'695'560.00	0.09
CH0124656247	2.1250 % PFZENT 2 1/8 02/21/20 4	1'990	0	0	1'990	CHF	109.18%	2'172'682.00	0.12
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 E	250	0	0	250	CHF	127.10%	317'750.00	0.02
CH0124853604	2.6250 % SGSNVX 2 5/8 03/08/19	2'920	0	0	2'920	CHF	107.20%	3'130'240.00	0.17
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 E	2'150	0	0	2'150	CHF	140.40%	3'018'600.00	0.16
CH0125062254	1.7500 % CRH 1 3/4 03/29/16 EMT	300	0	300	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0125062262	2.5000 % CRH 2 1/2 03/29/21 EMT	1'980	0	0	1'980	CHF	114.20%	2'261'160.00	0.12
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 E	530	0	0	530	CHF	154.15%	816'995.00	0.04
CH0125269230	2.1250 % DANBNK 2 1/8 05/17/18	980	0	0	980	CHF	104.80%	1'027'040.00	0.05
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	750	0	0	750	CHF	158.45%	1'188'375.00	0.06
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 E	1'320	0	0	1'320	CHF	127.35%	1'681'020.00	0.09
CH0126183034	1.7500 % ZKB 1 3/4 03/29/17 118	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0126183075	2.3750 % ZKB 2 3/8 03/29/23 119	500	0	0	500	CHF	117.50%	587'500.00	0.03
CH0126434262	2.3750 % HSBC 2 3/8 04/04/18 EM	1'350	0	0	1'350	CHF	104.65%	1'412'775.00	0.08
CH0126516043	2.6250 % INTNED 2 5/8 03/23/21 E	1'330	0	0	1'330	CHF	114.50%	1'522'850.00	0.08
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26	600	0	0	600	CHF	125.36%	752'160.00	0.04
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	1'130	0	0	1'130	CHF	153.90%	1'739'070.00	0.09
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'010	0	0	1'010	CHF	124.55%	1'257'955.00	0.07
CH0127181011	2.0000 % SWISS 2 05/25/22	12'887	1'900	0	14'787	CHF	117.06%	17'309'662.20	0.92
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	7'199	500	0	7'699	CHF	139.55%	10'743'954.50	0.57
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	16'312	1'400	0	17'712	CHF	143.50%	25'416'720.00	1.34
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	11'974	1'000	0	12'974	CHF	115.81%	15'025'189.40	0.80
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	16'164	0	0	16'164	CHF	130.79%	21'140'895.60	1.12
CH0127350368	2.1250 % PFZENT 2 1/8 04/06/20 4	1'130	0	0	1'130	CHF	109.44%	1'236'672.00	0.07
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 4	1'700	0	0	1'700	CHF	124.10%	2'109'700.00	0.11
CH0127593140	2.2500 % RY 2 1/4 04/21/21 EMTN	1'900	0	0	1'900	CHF	113.40%	2'154'600.00	0.11
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 E	900	600	0	1'500	CHF	119.80%	1'797'000.00	0.10
CH0127860226	2.6250 % ANZ 2 5/8 10/27/17 EMT	1'170	0	0	1'170	CHF	103.42%	1'210'014.00	0.06
CH0128114441	2.1250 % ZKB 2 1/8 04/15/19 121	500	0	0	500	CHF	106.80%	534'000.00	0.03
CH0128250518	1.6250 % DANBNK 1 5/8 06/09/16	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0128250583	3.3750 % LHNVD 3 3/8 06/10/21 EM	2'260	0	0	2'260	CHF	116.50%	2'632'900.00	0.14
CH0128705214	2.3750 % RAIFFS 2 3/8 05/10/18	2'130	0	0	2'130	CHF	104.40%	2'223'720.00	0.12
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	1'030	0	0	1'030	CHF	135.70%	1'397'710.00	0.07

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26	2'060	0	0	2'060	CHF	129.47%	2'667'082.00	0.14
CH0129040777	2.2500 % FHZNSW 2 1/4 05/05/17	710	0	0	710	CHF	102.05%	724'555.00	0.04
CH0129057367	2.3750 % WKBNSW 2 3/8 05/18/21	280	0	0	280	CHF	112.75%	315'700.00	0.02
CH0129410988	2.3750 % ZUGKAN 2 3/8 05/25/21	1'410	0	0	1'410	CHF	112.80%	1'590'480.00	0.08
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	3'270	0	0	3'270	CHF	154.55%	5'053'785.00	0.27
CH0130036566	3.0000 % SGSNVX 3 05/27/21	850	0	0	850	CHF	114.70%	974'950.00	0.05
CH0130104125	2.2500 % KBFRIB 2 1/4 06/14/21	570	0	0	570	CHF	112.35%	640'395.00	0.03
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	570	0	0	570	CHF	136.40%	777'480.00	0.04
CH0130420539	1.7500 % OKB 1 3/4 06/14/17 EMT	1'610	0	0	1'610	CHF	102.05%	1'643'005.00	0.09
CH0130433995	2.5000 % GIVNVX 2 1/2 06/15/18	1'170	0	0	1'170	CHF	105.15%	1'230'255.00	0.07
CH0130501304	2.7500 % KWLILI 2 3/4 06/09/23	570	0	0	570	CHF	110.45%	629'565.00	0.03
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	400	0	0	400	CHF	128.50%	514'000.00	0.03
CH0130720516	2.6250 % SGKNSW 2 5/8 06/30/21	850	0	0	850	CHF	112.15%	953'275.00	0.05
CH0131078435	3.0000 % ENELIM 3 06/23/20 EMT	500	0	0	500	CHF	111.90%	559'500.00	0.03
CH0131610740	2.2500 % PFZENT 2 1/4 06/16/23 4	2'825	0	0	2'825	CHF	117.48%	3'318'810.00	0.18
CH0131804616	3.0000 % BALHOL 3 07/07/21	2'250	0	0	2'250	CHF	114.70%	2'580'750.00	0.14
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	490	0	0	490	CHF	114.05%	558'845.00	0.03
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25	1'000	0	0	1'000	CHF	122.63%	1'226'300.00	0.07
CH0133090610	2.2500 % ZURNVX 2 1/4 07/27/17	1'520	0	1'520	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0133278686	2.2500 % CFF 2 1/4 08/09/19 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	108.75%	1'087'500.00	0.06
CH0134208427	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 12/18/17	600	0	0	600	CHF	102.73%	616'380.00	0.03
CH0134637187	1.5000 % DNBNO 1 1/2 02/24/17 E	2'310	0	0	2'310	CHF	101.19%	2'337'489.00	0.12
CH0135176318	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 05/24/17	2'430	0	1'500	930	CHF	101.48%	943'764.00	0.05
CH0136594337	1.6250 % EBN 1 5/8 10/03/23 EMT	130	0	0	130	CHF	113.15%	147'095.00	0.01
CH0136594386	2.0000 % PM 2 12/06/21	750	0	0	750	CHF	111.60%	837'000.00	0.04
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	570	0	0	570	CHF	120.35%	685'995.00	0.04
CH0136846992	1.3750 % PFZENT 1 3/8 09/02/21 4	2'810	0	0	2'810	CHF	109.15%	3'067'115.00	0.16
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 4	2'260	0	0	2'260	CHF	118.43%	2'676'518.00	0.14
CH0136940282	2.2500 % ALPHSW 2 1/4 09/20/21	1'050	0	0	1'050	CHF	101.50%	1'065'750.00	0.06
CH0137501174	2.0000 % AMXLMM 2 12/27/17	2'050	0	0	2'050	CHF	103.18%	2'115'190.00	0.11
CH0137659469	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/22	2'850	0	0	2'850	CHF	111.43%	3'175'755.00	0.17
CH0138460958	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 09/27/21	200	0	0	200	CHF	109.15%	218'300.00	0.01
CH0138773053	1.7500 % BMW 1 3/4 09/29/17 EMT	500	0	0	500	CHF	102.25%	511'250.00	0.03
CH0138775876	2.8750 % KORGAS 2 7/8 10/11/19	500	0	0	500	CHF	109.05%	545'250.00	0.03
CH0139265000	2.2500 % ABBNVX 2 1/4 10/11/21	1'455	0	0	1'455	CHF	111.85%	1'627'417.50	0.09
CH0139285388	1.5000 % LANHYP 1 1/2 10/24/18 E	1'170	0	0	1'170	CHF	104.70%	1'224'990.00	0.07
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	1'540	0	0	1'540	CHF	114.60%	1'764'840.00	0.09
CH0139756859	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 10/20/17 E	250	0	0	250	CHF	102.11%	255'275.00	0.01
CH0140410116	2.2500 % ADUHOL 2 1/4 10/27/17	420	0	0	420	CHF	103.00%	432'600.00	0.02
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	400	0	0	400	CHF	119.00%	476'000.00	0.03
CH0140939940	2.7500 % CAF 2 3/4 02/03/17 EMT	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 4	1'100	0	0	1'100	CHF	114.86%	1'263'460.00	0.07
CH0141428216	1.1250 % KBAARG 1 1/8 11/15/18	1'150	0	0	1'150	CHF	103.55%	1'190'825.00	0.06
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	570	2'000	0	2'570	CHF	115.40%	2'965'780.00	0.16
CH0141835576	2.3750 % ZURNVX 2 3/8 11/23/18 E	2'070	0	0	2'070	CHF	105.80%	2'190'060.00	0.12
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	2'200	0	0	2'200	CHF	116.65%	2'566'300.00	0.14
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	2'200	0	0	2'200	CHF	145.50%	3'201'000.00	0.17
CH0142821393	2.1250 % DGFP 2 1/8 12/15/17 EM	530	0	0	530	CHF	102.81%	544'893.00	0.03
CH0142821401	1.7500 % TLSAU 1 3/4 12/14/18 EM	350	0	0	350	CHF	105.00%	367'500.00	0.02
CH0142821443	1.0000 % NEDWBK 1 02/01/18 EM	500	0	0	500	CHF	102.40%	512'000.00	0.03
CH0142878344	1.0000 % ZKB 1 12/14/18 123	850	0	0	850	CHF	103.30%	878'050.00	0.05
CH0142882007	2.0000 % SBAB 2 12/06/18 EMTN	400	0	0	400	CHF	104.70%	418'800.00	0.02
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	700	0	0	700	CHF	112.00%	784'000.00	0.04
CH0142981890	1.2500 % GIVNVX 1 1/4 12/07/16	150	0	0	150	CHF	100.55%	150'825.00	0.01

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0142981940	2.1250 % GIVNVX 2 1/8 12/07/21	400	500	0	900	CHF	111.85%	1'006'650.00	0.05
CH0143218441	3.1250 % LONNVX 3 1/8 12/07/18	460	0	0	460	CHF	106.70%	490'820.00	0.03
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26		150	0	150	CHF	116.20%	174'300.00	0.01
CH0143383963	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/30/21	3'520	0	0	3'520	CHF	109.40%	3'850'880.00	0.20
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41	2'530	0	0	2'530	CHF	135.21%	3'420'813.00	0.18
CH0143838032	1.5000 % ANZ 1 1/2 02/13/19 EMT	1'530	0	0	1'530	CHF	105.35%	1'611'855.00	0.09
CH0143838354	1.5000 % ANVAU 1 1/2 02/21/17 E	1'000	0	0	1'000	CHF	100.86%	1'008'600.00	0.05
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24	500	0	0	500	CHF	114.05%	570'250.00	0.03
CH0144279061	1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/15/21 4	2'150	0	0	2'150	CHF	109.31%	2'350'165.00	0.12
CH0144934319	2.1250 % SRENVX 2 1/8 09/22/17	1'700	0	0	1'700	CHF	102.84%	1'748'280.00	0.09
CH0146652158	1.2500 % ZKB 1 1/4 01/31/22 124	1'550	0	0	1'550	CHF	108.30%	1'678'650.00	0.09
CH0146696528	1.5000 % ABBNVX 1 1/2 11/23/18	750	0	0	750	CHF	103.75%	778'125.00	0.04
CH0146698425	1.2500 % EIB 1 1/4 08/02/19	550	0	0	550	CHF	106.05%	583'275.00	0.03
CH0146796062	1.6250 % GE 1 5/8 10/19/17	700	0	0	700	CHF	102.39%	716'730.00	0.04
CH0146843443	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 02/01/22	400	0	0	400	CHF	107.35%	429'400.00	0.02
CH0147023466	2.0000 % RABOBK 2 02/06/19 EMT	1'070	0	0	1'070	CHF	105.25%	1'126'175.00	0.06
CH0147029299	2.5000 % HTHROW 2 1/2 02/08/17	100	0	0	100	CHF	101.40%	101'400.00	0.01
CH0147144346	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/17	2'200	0	2'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28	3'000	1'150	0	4'150	CHF	117.53%	4'877'495.00	0.26
CH0148059923	2.5000 % HYUCAP 2 1/2 02/15/17	950	0	0	950	CHF	101.55%	964'725.00	0.05
CH0148295014	2.2500 % BALHOL 2 1/4 03/01/19	850	0	0	850	CHF	105.80%	899'300.00	0.05
CH0148295436	0.8750 % PFZENT 0 7/8 12/03/18 4	2'450	0	0	2'450	CHF	103.26%	2'529'870.00	0.13
CH0148295451	1.2500 % PFZENT 1 1/4 02/03/22 4	2'980	0	0	2'980	CHF	108.84%	3'243'432.00	0.17
CH0148560995	3.0000 % IBESM 3 02/13/17 EMTN	700	0	0	700	CHF	101.80%	712'600.00	0.04
CH0148606079	1.6250 % CRH 1 5/8 03/05/19	1'100	0	0	1'100	CHF	105.50%	1'160'500.00	0.06
CH0148611426	2.5000 % ABNANV 2 1/2 02/16/17	850	0	850	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0148723965	1.0000 % CM 1 02/13/19 EMTN	1'950	0	0	1'950	CHF	104.05%	2'028'975.00	0.11
CH0148937649	1.2500 % KOMINS 1 1/4 02/28/22 E	2'745	0	0	2'745	CHF	110.60%	3'035'970.00	0.16
CH0149176122	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 08/13/19	2'130	500	0	2'630	CHF	104.04%	2'736'252.00	0.15
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24	1'570	500	0	2'070	CHF	112.10%	2'320'470.00	0.12
CH0149182450	1.5000 % ANZNZ 1 1/2 02/27/18 EM	1'250	0	0	1'250	CHF	103.40%	1'292'500.00	0.07
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	2'130	0	0	2'130	CHF	122.40%	2'607'120.00	0.14
CH0149428788	1.1250 % PCAR 1 1/8 03/06/17 EM	430	0	0	430	CHF	100.70%	433'010.00	0.02
CH0149710771	1.8750 % KOROIL 1 7/8 03/08/17 E	1'500	0	0	1'500	CHF	101.16%	1'517'400.00	0.08
CH0149897974	0.6250 % KBBL 0 5/8 02/27/18	970	0	0	970	CHF	101.60%	985'520.00	0.05
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	300	0	0	300	CHF	120.30%	360'900.00	0.02
CH0180006162	1.5000 % NDASS 1 1/2 09/29/17 E	2'250	0	0	2'250	CHF	101.98%	2'294'550.00	0.12
CH0180006170	2.1250 % AMCAU 2 1/8 04/04/18 E	710	0	0	710	CHF	103.35%	733'785.00	0.04
CH0180071463	1.5000 % CBAAU 1 1/2 09/13/19 E	700	0	0	700	CHF	106.20%	743'400.00	0.04
CH0180428531	2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42	1'030	0	0	1'030	CHF	124.50%	1'282'350.00	0.07
CH0180513068	1.0000 % ROSW 1 09/21/18	2'280	0	0	2'280	CHF	103.40%	2'357'520.00	0.13
CH0180513183	1.6250 % ROSW 1 5/8 09/23/22	900	0	0	900	CHF	111.35%	1'002'150.00	0.05
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 4	1'800	500	0	2'300	CHF	115.20%	2'649'600.00	0.14
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	500	0	0	500	CHF	122.45%	612'250.00	0.03
CH0181379774	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 04/25/18	1'620	0	0	1'620	CHF	104.35%	1'690'470.00	0.09
CH0181646883	2.5000 % PEMEX 2 1/2 04/10/19 E	1'020	0	0	1'020	CHF	104.45%	1'065'390.00	0.06
CH0181915585	2.7500 % SLOVAK 2 3/4 04/25/22	260	0	0	260	CHF	118.00%	306'800.00	0.02
CH0181932929	1.0000 % VAUD 1 06/07/22	990	0	0	990	CHF	108.55%	1'074'645.00	0.06
CH0181932945	0.7500 % TESSIN 0 3/4 06/11/20	570	0	0	570	CHF	104.40%	595'080.00	0.03
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	250	0	0	250	CHF	113.80%	284'500.00	0.02
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	800	0	0	800	CHF	134.50%	1'076'000.00	0.06
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	500	0	0	500	CHF	117.25%	586'250.00	0.03
CH0182595105	1.0000 % ABNANV 1 04/19/17 EMT	570	0	0	570	CHF	101.05%	575'985.00	0.03
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 4	2'450	150	0	2'600	CHF	119.17%	3'098'420.00	0.16

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0183141792	1.7500 % DNBNO 1 3/4 04/18/18 E	900	0	0	900	CHF	103.30%	929'700.00	0.05
CH0183365128	1.5000 % TEVA 1 1/2 10/25/18	685	0	0	685	CHF	103.15%	706'577.50	0.04
CH0183366167	1.2500 % BQNCNT 1 1/4 04/26/21	280	0	0	280	CHF	107.40%	300'720.00	0.02
CH0183380721	1.3750 % ASBBNK 1 3/8 11/02/18	645	0	0	645	CHF	103.95%	670'477.50	0.04
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27	2'350	0	0	2'350	CHF	116.93%	2'747'855.00	0.15
CH0184183322	3.0000 % ALPHSW 3 05/16/22	850	600	0	1'450	CHF	103.80%	1'505'100.00	0.08
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	10'750	0	0	10'750	CHF	119.59%	12'855'925.00	0.68
CH0184250261	2.2500 % POLAND 2 1/4 05/15/18	1'400	0	0	1'400	CHF	104.55%	1'463'700.00	0.08
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	1'100	0	0	1'100	CHF	128.30%	1'411'300.00	0.08
CH0184777255	1.1250 % CRH 1 1/8 09/21/17 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	101.92%	1'019'200.00	0.05
CH0184777271	1.8750 % CRH 1 7/8 05/23/22 EMT	700	0	0	700	CHF	113.40%	793'800.00	0.04
CH0184786181	1.5000 % BZLNZ 1 1/2 01/22/18 EM	1'150	0	0	1'150	CHF	102.35%	1'177'025.00	0.06
CH0184911904	0.5000 % GENEVA 0 1/2 05/29/17	250	0	0	250	CHF	100.98%	252'450.00	0.01
CH0184911953	1.2500 % GENEVA 1 1/4 12/29/22	1'000	0	0	1'000	CHF	110.75%	1'107'500.00	0.06
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	785	0	0	785	CHF	117.55%	922'767.50	0.05
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 4	1'680	300	0	1'980	CHF	119.01%	2'356'398.00	0.13
CH0185334973	1.0000 % LANSBK 1 05/29/19 EMT	820	0	0	820	CHF	104.50%	856'900.00	0.05
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	700	0	0	700	CHF	115.20%	806'400.00	0.04
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	700	0	0	700	CHF	116.25%	813'750.00	0.04
CH0185843007	0.6250 % EBN 0 5/8 07/04/19	790	0	0	790	CHF	103.05%	814'095.00	0.04
CH0185843015	1.1250 % EBN 1 1/8 07/04/24	780	0	0	780	CHF	110.50%	861'900.00	0.05
CH0185843023	2.6250 % GLENLN 2 5/8 12/03/18 E	1'550	0	0	1'550	CHF	103.85%	1'609'675.00	0.09
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 E	1'590	0	0	1'590	CHF	120.50%	1'915'950.00	0.10
CH0185996458	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 03/15/19	2'760	0	0	2'760	CHF	103.11%	2'845'836.00	0.15
CH0186130446	1.7500 % SKM 1 3/4 06/12/17	1'310	0	0	1'310	CHF	101.98%	1'335'938.00	0.07
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	1'410	0	0	1'410	CHF	109.15%	1'539'015.00	0.08
CH0186163991	1.0000 % SIKI 1 07/12/18	790	0	0	790	CHF	102.15%	806'985.00	0.04
CH0186164007	1.7500 % SIKI 1 3/4 07/12/22	790	0	0	790	CHF	109.55%	865'445.00	0.05
CH0186472491	0.7500 % GRKPSW 0 3/4 06/14/19	250	0	0	250	CHF	103.10%	257'750.00	0.01
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	500	0	0	500	CHF	110.70%	553'500.00	0.03
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	750	0	0	750	CHF	114.55%	859'125.00	0.05
CH0187218901	3.0000 % LHNVS 3 11/22/22	1'800	0	0	1'800	CHF	117.45%	2'114'100.00	0.11
CH0187694366	1.2500 % FHZNSW 1 1/4 07/03/20	1'050	0	0	1'050	CHF	104.90%	1'101'450.00	0.06
CH0187695553	2.0000 % LGT 2 07/02/19	250	0	0	250	CHF	106.60%	266'500.00	0.01
CH0187696114	2.0000 % LGELEC 2 12/02/16	710	0	0	710	CHF	100.66%	714'686.00	0.04
CH0188098740	1.5000 % ZURNVS 1 1/2 06/25/19 E	2'190	0	0	2'190	CHF	104.65%	2'291'835.00	0.12
CH0188295536	1.0000 % BALHOL 1 10/12/17	415	0	0	415	CHF	101.22%	420'063.00	0.02
CH0188335365	1.7500 % SCMNVS 1 3/4 07/10/24	1'750	0	0	1'750	CHF	114.15%	1'997'625.00	0.11
CH0188726811	1.2500 % COOPSW 1 1/4 07/25/19	1'030	0	0	1'030	CHF	103.95%	1'070'685.00	0.06
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	1'800	0	0	1'800	CHF	116.90%	2'104'200.00	0.11
CH0188931841	1.3750 % ACACB 1 3/8 07/30/18 E	400	0	0	400	CHF	103.95%	415'800.00	0.02
CH0188931932	1.1250 % NAB 1 1/8 11/07/18 EMT	910	0	0	910	CHF	103.15%	938'665.00	0.05
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 4	1'000	1'000	0	2'000	CHF	111.92%	2'238'400.00	0.12
CH0189276030	1.8750 % ADENVX 1 7/8 12/18/17	975	0	0	975	CHF	102.60%	1'000'350.00	0.05
CH0189276055	2.6250 % ADENVX 2 5/8 12/18/20	380	0	0	380	CHF	111.60%	424'080.00	0.02
CH0190125044	1.1250 % NDASS 1 1/8 10/02/20 E	1'000	0	0	1'000	CHF	105.05%	1'050'500.00	0.06
CH0190125051	1.0000 % OKB 1 09/28/21	200	800	0	1'000	CHF	108.45%	1'084'500.00	0.06
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24	1'000	0	0	1'000	CHF	114.00%	1'140'000.00	0.06
CH0190369048	3.0000 % MQGAU 3 08/09/17 EMT	745	0	0	745	CHF	103.51%	771'149.50	0.04
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33	2'870	0	0	2'870	CHF	124.03%	3'559'661.00	0.19
CH0192241252	1.0000 % PSHYPO 1 08/13/21 571	3'500	0	0	3'500	CHF	106.96%	3'743'600.00	0.20
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27	1'500	150	0	1'650	CHF	115.79%	1'910'535.00	0.10
CH0192251863	1.5000 % CAF 1 1/2 09/11/18 EMT	1'700	0	0	1'700	CHF	103.80%	1'764'600.00	0.09
CH0192892757	1.1250 % AMXLMM 1 1/8 09/12/18	1'250	0	0	1'250	CHF	102.20%	1'277'500.00	0.07

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0192941083	0.1250 % KTBS 0 1/8 08/29/17	1'250	0	0	1'250	CHF	100.79%	1'259'875.00	0.07
CH0193069835	1.1250 % BNG 1 1/8 09/13/22 EMT	2'000	0	0	2'000	CHF	110.45%	2'209'000.00	0.12
CH0193265995	1.0000 % GLRNKB 1 09/21/22	250	0	0	250	CHF	107.00%	267'500.00	0.01
CH0193296990	1.0000 % PM 1 09/18/20 EMTN	1'400	0	0	1'400	CHF	104.95%	1'469'300.00	0.08
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	800	0	0	800	CHF	115.15%	921'200.00	0.05
CH0193486021	1.1250 % BZLNZ 1 1/8 09/20/19 EM	800	0	0	800	CHF	103.80%	830'400.00	0.04
CH0193717540	1.0000 % PFZENT 1 09/09/22 425	2'550	0	0	2'550	CHF	108.00%	2'754'000.00	0.15
CH0193744916	1.0000 % ZUGKAN 1 09/26/22	1'500	500	0	2'000	CHF	107.40%	2'148'000.00	0.11
CH0193764930	1.5000 % DANBNK 1 1/2 12/21/16	1'050	0	0	1'050	CHF	100.70%	1'057'350.00	0.06
CH0193819585	1.7500 % NYKRE 1 3/4 09/26/16 E	400	0	0	400	CHF	100.25%	401'000.00	0.02
CH0194112071	1.0000 % KBBL 1 10/04/22	1'550	1'000	0	2'550	CHF	107.65%	2'745'075.00	0.15
CH0194273162	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/15/18		600	0	600	CHF	101.40%	608'400.00	0.03
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29	3'600	500	0	4'100	CHF	117.71%	4'826'110.00	0.26
CH0194352271	0.7500 % KBSCHW 0 3/4 10/05/20	500	0	0	500	CHF	104.35%	521'750.00	0.03
CH0194405335	1.2500 % RABOBK 1 1/4 10/15/20	500	0	0	500	CHF	105.40%	527'000.00	0.03
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	700	0	0	700	CHF	111.55%	780'850.00	0.04
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	500	0	0	500	CHF	110.90%	554'500.00	0.03
CH0194695208	1.0000 % GENEVA 1 10/26/22	1'500	0	0	1'500	CHF	108.75%	1'631'250.00	0.09
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	500	0	0	500	CHF	114.35%	571'750.00	0.03
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	1'200	0	0	1'200	CHF	124.45%	1'493'400.00	0.08
CH0194958986	1.3750 % SHBASS 1 3/8 10/05/22	800	0	0	800	CHF	109.25%	874'000.00	0.05
CH0195062028	2.0000 % LONNVX 2 10/11/18	900	0	0	900	CHF	103.70%	933'300.00	0.05
CH0195062036	3.0000 % LONNVX 3 10/11/22	250	0	0	250	CHF	115.20%	288'000.00	0.02
CH0195288102	1.1250 % ENGIFP 1 1/8 10/09/20 E	700	0	0	700	CHF	104.50%	731'500.00	0.04
CH0195288193	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 E	400	0	0	400	CHF	113.45%	453'800.00	0.02
CH0195757254	2.7500 % ENELIM 2 3/4 12/17/18 E	1'000	0	0	1'000	CHF	106.35%	1'063'500.00	0.06
CH0196124355	2.0000 % LITHUN 2 04/11/18	1'000	0	0	1'000	CHF	104.20%	1'042'000.00	0.06
CH0196770454	1.0000 % PSPNSW 1 02/08/19	1'000	0	0	1'000	CHF	102.30%	1'023'000.00	0.05
CH0196878661	1.1250 % EIB 1 1/8 04/26/23	500	1'000	0	1'500	CHF	112.15%	1'682'250.00	0.09
CH0196924036	1.0000 % KDB 1 10/29/18 EMTN	500	0	0	500	CHF	102.45%	512'250.00	0.03
CH0197368654	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/19	1'200	900	0	2'100	CHF	102.75%	2'157'750.00	0.11
CH0197841569	2.7180 % TELEFO 2.718 12/14/18	1'060	0	0	1'060	CHF	105.95%	1'123'070.00	0.06
CH0198104579	1.0000 % RFLBNI 1 11/12/20 EMTN	500	0	0	500	CHF	105.30%	526'500.00	0.03
CH0198323484	1.0000 % THURBK 1 11/30/22	500	0	0	500	CHF	108.00%	540'000.00	0.03
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMT	150	0	0	150	CHF	128.80%	193'200.00	0.01
CH0198619444	1.0000 % KORAIL 1 11/16/18 EMT	650	0	0	650	CHF	102.40%	665'600.00	0.04
CH0198800291	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/15/19 4	1'100	0	0	1'100	CHF	102.75%	1'130'250.00	0.06
CH0198800325	1.0000 % PFZENT 1 02/13/23 427	1'000	0	0	1'000	CHF	108.32%	1'083'200.00	0.06
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	600	0	0	600	CHF	127.05%	762'300.00	0.04
CH0199382042	1.0000 % VALIAN 1 11/20/18	850	0	0	850	CHF	102.50%	871'250.00	0.05
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	600	150	0	750	CHF	117.65%	882'375.00	0.05
CH0199543528	0.5000 % ZURICH 0 1/2 12/03/20	1'770	0	0	1'770	CHF	104.65%	1'852'305.00	0.10
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	400	500	0	900	CHF	112.70%	1'014'300.00	0.05
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	800	0	0	800	CHF	121.65%	973'200.00	0.05
CH0199544781	2.1250 % MQGAU 2 1/8 11/29/18 E	200	0	0	200	CHF	105.05%	210'100.00	0.01
CH0199544989	3.0000 % MQGAU 3 11/29/22 EMT	810	0	0	810	CHF	117.75%	953'775.00	0.05
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23	3'430	0	0	3'430	CHF	109.88%	3'768'884.00	0.20
CH0199773224	0.3750 % SOLEUR 0 3/8 11/29/19	300	0	0	300	CHF	103.05%	309'150.00	0.02
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	950	1'000	0	1'950	CHF	114.75%	2'237'625.00	0.12
CH0200044771	1.5000 % NANTDR 1 1/2 02/15/21	960	0	0	960	CHF	102.95%	988'320.00	0.05
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	800	0	0	800	CHF	106.45%	851'600.00	0.05
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	300	0	0	300	CHF	111.55%	334'650.00	0.02
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	1'600	0	0	1'600	CHF	110.55%	1'768'800.00	0.09
CH0200252812	1.1250 % ANVAU 1 1/8 04/18/19 E	1'600	0	0	1'600	CHF	103.40%	1'654'400.00	0.09

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0200252820	1.5000 % CABEI 1 1/2 02/04/20	250	0	0	250	CHF	105.35%	263'375.00	0.01
CH0200252838	1.8750 % LGT 1 7/8 02/08/23	1'300	0	0	1'300	CHF	112.35%	1'460'550.00	0.08
CH0200370218	0.8750 % EGW 0 7/8 03/24/23 44	400	0	0	400	CHF	108.45%	433'800.00	0.02
CH0200404173	1.5000 % GS 1 1/2 11/29/18 EMTN	1'570	0	0	1'570	CHF	103.50%	1'624'950.00	0.09
CH0201225197	1.0000 % KDB 1 12/21/18 EMTN	500	0	0	500	CHF	102.90%	514'500.00	0.03
CH0201297212	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/13/18	1'750	500	0	2'250	CHF	101.68%	2'287'800.00	0.12
CH0201591705	0.8750 % PFZENT 0 7/8 06/20/22 4	3'300	0	0	3'300	CHF	107.01%	3'531'330.00	0.19
CH0203695629	0.8750 % KUNTA 0 7/8 02/01/23 E	800	0	0	800	CHF	109.50%	876'000.00	0.05
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	1'700	0	0	1'700	CHF	109.70%	1'864'900.00	0.10
CH0204017005	1.1250 % AUCCN 1 1/8 02/07/24	1'200	0	0	1'200	CHF	112.00%	1'344'000.00	0.07
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	1'200	0	0	1'200	CHF	125.55%	1'506'600.00	0.08
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	750	0	0	750	CHF	116.60%	874'500.00	0.05
CH0204477241	2.2500 % BLDAU 2 1/4 02/20/20 EM	500	0	0	500	CHF	104.20%	521'000.00	0.03
CH0204477258	1.6250 % NAB 1 5/8 09/05/23 EMT	1'100	0	0	1'100	CHF	111.50%	1'226'500.00	0.07
CH0204477290	1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23	1'700	0	0	1'700	CHF	111.60%	1'897'200.00	0.10
CH0204477688	0.8750 % CBAU 0 7/8 02/11/20 E	250	0	0	250	CHF	103.55%	258'875.00	0.01
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 4	3'300	150	0	3'450	CHF	115.61%	3'988'545.00	0.21
CH0204567322	1.3750 % CAF 1 3/8 02/11/21 EMT	1'500	0	0	1'500	CHF	107.30%	1'609'500.00	0.09
CH0204574914	2.1250 % GASSM 2 1/8 02/08/19 E	450	0	0	450	CHF	104.85%	471'825.00	0.03
CH0204678020	1.1250 % KORGAS 1 1/8 02/12/20	1'330	0	0	1'330	CHF	103.70%	1'379'210.00	0.07
CH0204811076	1.0000 % SWISSG 1 01/30/20	210	0	0	210	CHF	103.85%	218'085.00	0.01
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	1'100	0	0	1'100	CHF	113.95%	1'253'450.00	0.07
CH0205276683	1.6250 % STMNSW 1 5/8 04/30/20	650	0	0	650	CHF	104.85%	681'525.00	0.04
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	1'500	0	0	1'500	CHF	121.50%	1'822'500.00	0.10
CH0205287706	0.8750 % ANZNZ 0 7/8 02/14/19 EM	600	0	0	600	CHF	102.70%	616'200.00	0.03
CH0205310904	1.1250 % KBSCHW 1 1/8 02/20/23	1'200	0	0	1'200	CHF	108.55%	1'302'600.00	0.07
CH0205409011	1.6250 % GS 1 5/8 02/06/20 EMTN	900	0	0	900	CHF	105.30%	947'700.00	0.05
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	500	0	0	500	CHF	110.35%	551'750.00	0.03
CH0205832618	1.1250 % Q 1 1/8 02/22/23 EMTN	600	0	0	600	CHF	110.30%	661'800.00	0.04
CH0206074871	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/19/18	2'550	0	0	2'550	CHF	101.72%	2'593'860.00	0.14
CH0206368174	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/02/18 4	4'080	0	0	4'080	CHF	101.79%	4'153'032.00	0.22
CH0206594498	1.3750 % SLOVAK 1 3/8 10/16/19	1'650	0	0	1'650	CHF	105.50%	1'740'750.00	0.09
CH0206594506	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 10/16/23	700	0	0	700	CHF	117.30%	821'100.00	0.04
CH0206594514	0.3130 % BSKYS 0.313 05/15/16	1'420	0	1'420	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	500	0	0	500	CHF	118.00%	590'000.00	0.03
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	2'250	0	0	2'250	CHF	112.80%	2'538'000.00	0.13
CH0206903764	0.8750 % PM 0 7/8 03/11/19	1'600	0	0	1'600	CHF	103.40%	1'654'400.00	0.09
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	650	500	0	1'150	CHF	115.80%	1'331'700.00	0.07
CH0207550010	1.1250 % BNG 1 1/8 04/19/23 EMT	300	0	0	300	CHF	111.35%	334'050.00	0.02
CH0207960649	0.8750 % NDASS 0 7/8 09/25/18 E	1'500	0	0	1'500	CHF	102.25%	1'533'750.00	0.08
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	500	0	0	500	CHF	132.85%	664'250.00	0.04
CH0208309291	1.0000 % INTNED 1 09/14/18 EMT	600	0	0	600	CHF	102.20%	613'200.00	0.03
CH0208323441	1.2500 % GENEVA 1 1/4 03/22/23	700	0	0	700	CHF	110.85%	775'950.00	0.04
CH0208580693	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 03/28/23	400	0	0	400	CHF	108.65%	434'600.00	0.02
CH0208701380	1.1250 % KBBL 1 1/8 03/27/23	1'400	0	0	1'400	CHF	108.75%	1'522'500.00	0.08
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	800	0	0	800	CHF	130.25%	1'042'000.00	0.06
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	550	0	0	550	CHF	116.85%	642'675.00	0.03
CH0209472064	1.1250 % HELNSW 1 1/8 04/08/19	230	0	0	230	CHF	103.10%	237'130.00	0.01
CH0209474631	1.7500 % LONNVX 1 3/4 04/10/19	1'650	0	0	1'650	CHF	103.80%	1'712'700.00	0.09
CH0209654984	1.1250 % LANSBK 1 1/8 04/11/23 E	750	0	0	750	CHF	110.20%	826'500.00	0.04
CH0209675211	1.6250 % BFCM 1 5/8 04/11/23 EM	500	0	0	500	CHF	108.05%	540'250.00	0.03
CH0209886511	1.0000 % KIWI 1 12/23/20 EMTN	380	0	0	380	CHF	106.70%	405'460.00	0.02
CH0210240302	0.8750 % PFZENT 0 7/8 04/16/21 4	1'100	0	0	1'100	CHF	106.05%	1'166'550.00	0.06
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 4	1'200	0	0	1'200	CHF	113.40%	1'360'800.00	0.07

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0210362791	1.5000 % FHZNSW 1 1/2 04/17/23	800	0	0	800	CHF	109.15%	873'200.00	0.05
CH0210384134	1.0000 % NAB 1 04/17/20 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	104.65%	1'360'450.00	0.07
CH0210461312	1.1250 % KBSH 1 1/8 04/24/23	550	0	0	550	CHF	108.70%	597'850.00	0.03
CH0210770365	0.4000 % SCARD 0.4 06/15/16 A	200	0	200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0211588915	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 09/29/23	2'600	500	0	3'100	CHF	111.00%	3'441'000.00	0.18
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30	1'975	500	0	2'475	CHF	121.95%	3'018'262.50	0.16
CH0212184052	1.0000 % RELLN 1 12/18/18	500	0	0	500	CHF	101.75%	508'750.00	0.03
CH0212184060	1.1250 % SLHNVX 1 1/8 06/21/19	1'200	0	0	1'200	CHF	103.25%	1'239'000.00	0.07
CH0212184078	1.8750 % SLHNVX 1 7/8 06/21/23	700	0	0	700	CHF	111.40%	779'800.00	0.04
CH0212267337	1.7500 % BELLSW 1 3/4 05/16/22	100	0	0	100	CHF	109.75%	109'750.00	0.01
CH0212365818	0.8750 % ZKB 0 7/8 05/17/21 130	900	0	0	900	CHF	105.60%	950'400.00	0.05
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	2'200	0	0	2'200	CHF	129.75%	2'854'500.00	0.15
CH0212771601	1.1250 % BNCHIL 1 1/8 05/23/18	220	0	0	220	CHF	102.25%	224'950.00	0.01
CH0212937228	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 06/19/18	700	0	0	700	CHF	101.55%	710'850.00	0.04
CH0212937236	1.5000 % ACHMEA 1 1/2 06/19/19	550	0	0	550	CHF	103.85%	571'175.00	0.03
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	900	0	0	900	CHF	118.30%	1'064'700.00	0.06
CH0212937251	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/24/23	1'050	0	0	1'050	CHF	112.50%	1'181'250.00	0.06
CH0213373290	0.8750 % SRBANK 0 7/8 11/30/18	1'350	0	0	1'350	CHF	102.05%	1'377'675.00	0.07
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	300	0	0	300	CHF	138.00%	414'000.00	0.02
CH0214027606	0.8750 % ASBBNK 0 7/8 06/11/19	600	0	0	600	CHF	102.70%	616'200.00	0.03
CH0214365618	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 04/15/19	2'200	0	0	2'200	CHF	102.55%	2'256'100.00	0.12
CH0214925825	1.0000 % ENAG 1 12/14/18	150	0	0	150	CHF	101.05%	151'575.00	0.01
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	300	0	0	300	CHF	119.80%	359'400.00	0.02
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	500	0	0	500	CHF	144.40%	722'000.00	0.04
CH0214926088	1.6250 % EMMI 1 5/8 07/12/23 .	1'450	0	0	1'450	CHF	110.05%	1'595'725.00	0.08
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 4	1'850	150	0	2'000	CHF	117.94%	2'358'800.00	0.13
CH0215076313	1.6250 % KOWEPW 1 5/8 03/26/19	700	0	0	700	CHF	104.15%	729'050.00	0.04
CH0215076321	0.5000 % INTNED 0 1/2 09/13/16 E	500	0	0	500	CHF	100.13%	500'650.00	0.03
CH0215076339	1.5000 % ABNANV 1 1/2 12/27/19	900	0	0	900	CHF	105.10%	945'900.00	0.05
CH0215076354	1.7500 % BSANCI 1 3/4 09/26/19	700	0	0	700	CHF	105.15%	736'050.00	0.04
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'300	0	0	1'300	CHF	133.35%	1'733'550.00	0.09
CH0215645661	1.1250 % SPSNSW 1 1/8 07/11/18	500	0	0	500	CHF	102.35%	511'750.00	0.03
CH0215650711	2.0000 % KKGDSW 2 09/30/20	400	0	0	400	CHF	103.25%	413'000.00	0.02
CH0215650737	2.0000 % SPSNSW 2 10/21/20	800	0	0	800	CHF	106.95%	855'600.00	0.05
CH0215690402	1.1250 % MET 1 1/8 06/18/20 EMT	700	0	0	700	CHF	104.70%	732'900.00	0.04
CH0216320710	1.2500 % SEK 1 1/4 07/17/23 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	112.45%	1'124'500.00	0.06
CH0217374286	1.1250 % OKB 1 1/8 07/24/20	1'500	500	0	2'000	CHF	107.10%	2'142'000.00	0.11
CH0217579736	1.1250 % BNCHIL 1 1/8 07/25/17	700	0	0	700	CHF	101.50%	710'500.00	0.04
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	400	0	0	400	CHF	123.30%	493'200.00	0.03
CH0217677605	1.2500 % ENBW 1 1/4 07/12/18 EM	300	0	0	300	CHF	102.65%	307'950.00	0.02
CH0217677654	2.2500 % ENBW 2 1/4 07/12/23 EM	400	0	0	400	CHF	109.85%	439'400.00	0.02
CH0217678538	1.3750 % VORHYP 1 3/8 07/25/18	800	0	0	800	CHF	102.45%	819'600.00	0.04
CH0217756631	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 05/10/21	2'850	0	0	2'850	CHF	107.82%	3'072'870.00	0.16
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25	3'450	0	0	3'450	CHF	116.97%	4'035'465.00	0.21
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	1'100	0	0	1'100	CHF	122.95%	1'352'450.00	0.07
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	600	0	0	600	CHF	143.20%	859'200.00	0.05
CH0217850673	1.2500 % ZURICH 1 1/4 07/29/22	1'400	0	0	1'400	CHF	110.50%	1'547'000.00	0.08
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'000	0	0	1'000	CHF	121.00%	1'210'000.00	0.06
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	1'300	0	0	1'300	CHF	143.05%	1'859'650.00	0.10
CH0217986378	1.6250 % KOROIL 1 5/8 11/29/18 E	550	0	0	550	CHF	103.75%	570'625.00	0.03
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 4	1'300	0	0	1'300	CHF	117.37%	1'525'810.00	0.08
CH0219080048	1.5000 % CAF 1 1/2 08/13/20 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	107.30%	1'073'000.00	0.06
CH0220684614	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/15/22	4'360	0	0	4'360	CHF	110.25%	4'806'900.00	0.26
CH0221386136	1.5000 % GEOFIS 1 1/2 09/12/18	250	0	0	250	CHF	102.85%	257'125.00	0.01

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0221386144	2.5000 % GEOFIS 2 1/2 09/12/22	150	0	0	150	CHF	112.35%	168'525.00	0.01
CH0221732040	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 09/13/22	100	0	0	100	CHF	110.50%	110'500.00	0.01
CH0221961730	1.2500 % BERN 1 1/4 09/20/21	1'200	0	0	1'200	CHF	109.00%	1'308'000.00	0.07
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	400	0	0	400	CHF	114.90%	459'600.00	0.02
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'500	0	0	1'500	CHF	121.25%	1'818'750.00	0.10
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	500	150	0	650	CHF	130.05%	845'325.00	0.04
CH0222136506	1.1250 % PFZENT 1 1/8 06/12/20 4	2'000	0	0	2'000	CHF	106.05%	2'121'000.00	0.11
CH0222136654	2.0000 % ALLNSW 2 09/23/20	850	0	0	850	CHF	107.75%	915'875.00	0.05
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	1'750	0	0	1'750	CHF	115.10%	2'014'250.00	0.11
CH0222359421	1.2500 % SHBASS 1 1/4 12/20/19	700	0	0	700	CHF	104.75%	733'250.00	0.04
CH0222418235	1.5000 % KORELE 1 1/2 04/23/19	600	0	0	600	CHF	104.60%	627'600.00	0.03
CH0222418268	2.5000 % BREPW 2 1/2 10/08/18 E	500	0	0	500	CHF	102.20%	511'000.00	0.03
CH0222418300	2.5950 % TELEFO 2.595 10/23/20	950	0	0	950	CHF	108.80%	1'033'600.00	0.05
CH0222433291	1.0000 % CBAAU 1 09/25/18 EMTN	2'200	0	0	2'200	CHF	102.40%	2'252'800.00	0.12
CH0222705979	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 09/18/19	1'400	0	0	1'400	CHF	104.00%	1'456'000.00	0.08
CH0222705987	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/18/23	900	0	0	900	CHF	113.35%	1'020'150.00	0.05
CH0222760826	1.3750 % KBSCHW 1 3/8 09/24/21	1'300	0	0	1'300	CHF	108.65%	1'412'450.00	0.08
CH0222948678	1.5000 % KUNNSW 1 1/2 10/28/19	800	0	0	800	CHF	100.80%	806'400.00	0.04
CH0223059368	1.0000 % KOLAHO 1 10/04/16	300	0	0	300	CHF	100.19%	300'570.00	0.02
CH0223311959	1.0000 % GLRNKB 1 10/04/19	500	0	0	500	CHF	103.65%	518'250.00	0.03
CH0223523298	1.3750 % KDB 1 3/8 07/02/18 EMT	800	0	0	800	CHF	102.90%	823'200.00	0.04
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	5'950	2'220	0	8'170	CHF	118.89%	9'713'313.00	0.52
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	7'900	550	0	8'450	CHF	194.82%	16'462'290.00	0.88
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	3'500	2'000	0	5'500	CHF	113.12%	6'221'600.00	0.33
CH0224397262	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26 FE		1'400	1'400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224397270	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42 FE		1'400	1'400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224397296	4.0000 % SWISS 4 01/06/49 MAR		5'000	5'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224397304	2.0000 % SWISS 2 05/25/22 APR		400	400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224397312	2.0000 % SWISS 2 06/25/64 APR		550	550	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224397320	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26 M		820	820	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58		3'600	0	3'600	CHF	123.22%	4'435'920.00	0.24
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29		1'700	0	1'700	CHF	105.56%	1'794'520.00	0.10
CH0224397353	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58 JU		2'200	2'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	2'000	0	0	2'000	CHF	135.00%	2'700'000.00	0.14
CH0224486362	0.7500 % RY 0 3/4 10/23/18 EMTN	2'200	0	0	2'200	CHF	102.80%	2'261'600.00	0.12
CH0224574647	1.5000 % WKBNSW 1 1/2 10/28/22	800	0	0	800	CHF	110.40%	883'200.00	0.05
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	450	0	0	450	CHF	135.20%	608'400.00	0.03
CH0224761509	1.1250 % SIKI 1 1/8 11/14/19	750	0	0	750	CHF	103.60%	777'000.00	0.04
CH0224761517	1.8750 % SIKI 1 7/8 11/14/23	600	0	0	600	CHF	112.15%	672'900.00	0.04
CH0224761525	0.5000 % ZURICH 0 1/2 06/06/19	600	0	0	600	CHF	103.15%	618'900.00	0.03
CH0224761533	1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23	1'350	0	0	1'350	CHF	113.15%	1'527'525.00	0.08
CH0224904018	1.1250 % ZUGKAN 1 1/8 10/29/20	700	0	0	700	CHF	106.05%	742'350.00	0.04
CH0224923497	1.5000 % MOBNSW 1 1/2 10/29/18	250	0	0	250	CHF	103.20%	258'000.00	0.01
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	200	0	0	200	CHF	116.45%	232'900.00	0.01
CH0225071585	0.8750 % HILTI 0 7/8 10/30/18	160	0	0	160	CHF	102.05%	163'280.00	0.01
CH0225071593	1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23	420	0	0	420	CHF	113.40%	476'280.00	0.03
CH0225173290	1.5000 % KORAIL 1 1/2 12/02/19 E	500	0	0	500	CHF	105.25%	526'250.00	0.03
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	1'350	0	0	1'350	CHF	114.40%	1'544'400.00	0.08
CH0225323283	1.1250 % ABNANV 1 1/8 10/25/18	1'515	0	0	1'515	CHF	102.60%	1'554'390.00	0.08
CH0225710588	2.1250 % GLENLN 2 1/8 12/23/19 E	700	0	0	700	CHF	103.40%	723'800.00	0.04
CH0225941464	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/31/17 4	1'500	0	0	1'500	CHF	101.25%	1'518'750.00	0.08
CH0225941605	1.2500 % PFZENT 1 1/4 10/29/21 4	1'650	0	0	1'650	CHF	108.48%	1'789'920.00	0.10
CH0226752290	2.0000 % ULFP 2 11/20/23 EMTN	400	0	0	400	CHF	112.25%	449'000.00	0.02
CH0226869052	0.6250 % TESSIN 0 5/8 03/21/19	500	0	0	500	CHF	102.40%	512'000.00	0.03

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.02.2016	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.07.2016	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
CH0226869060	1.3750 % TESSIN 1 3/8 11/21/22	700	0	0	700	CHF	111.05%	777'350.00	0.04
CH0227343164	0.5000 % KTBS 0 1/2 11/28/18	1'200	0	0	1'200	CHF	102.55%	1'230'600.00	0.07
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	500	0	0	500	CHF	111.90%	559'500.00	0.03
CH0227975528	1.1250 % CMBNSW 1 1/8 11/29/17	800	0	0	800	CHF	101.37%	810'960.00	0.04
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	700	0	0	700	CHF	114.30%	800'100.00	0.04
CH0228199243	2.8750 % ENAPCL 2 7/8 12/05/18	100	0	0	100	CHF	103.15%	103'150.00	0.01
CH0228207574	1.5000 % BNCHIL 1 1/2 12/03/19	375	0	0	375	CHF	104.65%	392'437.50	0.02
CH0228518533	1.5000 % CABEI 1 1/2 12/16/19 EM	600	0	0	600	CHF	104.80%	628'800.00	0.03
CH0228531452	2.0000 % LHNVS 2 06/09/22	1'200	0	0	1'200	CHF	110.25%	1'323'000.00	0.07
CH0228531478	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/20	700	0	0	700	CHF	104.05%	728'350.00	0.04
CH0228622384	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/16/23	1'800	0	0	1'800	CHF	111.69%	2'010'420.00	0.11
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33	1'600	0	0	1'600	CHF	135.04%	2'160'640.00	0.11
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	600	0	0	600	CHF	146.30%	877'800.00	0.05
CH0229001000	1.2500 % CDCEPS 1 1/4 12/16/20	1'000	0	0	1'000	CHF	107.70%	1'077'000.00	0.06
CH0229318107	1.0000 % BSANCI 1 07/31/17	1'150	0	0	1'150	CHF	101.41%	1'166'215.00	0.06
CH0229318131	1.8750 % CABEI 1 7/8 02/25/22 EM	1'000	0	0	1'000	CHF	109.85%	1'098'500.00	0.06
CH0229571655	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/17 4	750	0	0	750	CHF	101.23%	759'225.00	0.04
CH0229571770	1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/12/22 4	1'800	0	0	1'800	CHF	110.65%	1'991'700.00	0.11
CH0229881138	1.3750 % PSPNSW 1 3/8 02/04/20	500	0	0	500	CHF	104.75%	523'750.00	0.03
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	1'000	0	0	1'000	CHF	145.30%	1'453'000.00	0.08
CH0232635869	1.3750 % BZLNZ 1 3/8 02/03/21 EM	500	0	0	500	CHF	106.30%	531'500.00	0.03
CH0232663549	1.1250 % ABNANV 1 1/8 01/31/19	1'350	0	0	1'350	CHF	102.95%	1'389'825.00	0.07
CH0232698719	1.5000 % ZKB 1 1/2 01/27/23 132	500	0	0	500	CHF	111.30%	556'500.00	0.03
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	500	0	0	500	CHF	114.35%	571'750.00	0.03
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	1'250	0	0	1'250	CHF	118.50%	1'481'250.00	0.08
CH0233216016	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 03/03/21	2'750	0	0	2'750	CHF	107.04%	2'943'600.00	0.16
CH0233226213	1.6250 % RAIFFS 1 5/8 02/07/22	1'050	0	0	1'050	CHF	109.25%	1'147'125.00	0.06
CH0233226262	1.1250 % ASBBNK 1 1/8 02/05/20	900	0	0	900	CHF	104.15%	937'350.00	0.05
CH0233341657	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 02/05/21	1'300	0	0	1'300	CHF	106.40%	1'383'200.00	0.07
CH0233680203	1.5000 % LGT 1 1/2 05/10/21	1'350	0	0	1'350	CHF	107.55%	1'451'925.00	0.08
CH0233720660	1.1250 % BFCM 1 1/8 02/12/19 EM	400	0	0	400	CHF	102.65%	410'600.00	0.02
CH0233911772	1.5000 % CBAAU 1 1/2 02/07/22 E	1'550	0	0	1'550	CHF	108.75%	1'685'625.00	0.09
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMT	600	500	0	1'100	CHF	115.80%	1'273'800.00	0.07
CH0234274444	1.2500 % ALLNSW 1 1/4 04/02/19	600	0	0	600	CHF	102.90%	617'400.00	0.03
CH0234274493	1.7500 % SPSNSW 1 3/4 04/16/21	1'100	0	0	1'100	CHF	106.05%	1'166'550.00	0.06
CH0234487384	1.0000 % ANZNS 1 03/10/20 EMTN	1'050	0	0	1'050	CHF	104.10%	1'093'050.00	0.06
CH0234487392	3.0000 % BPCLIN 3 12/20/19 EMT	350	0	0	350	CHF	108.05%	378'175.00	0.02
CH0234487400	1.1250 % BENAU 1 1/8 03/25/19 E	700	0	0	700	CHF	102.60%	718'200.00	0.04
CH0234487426	3.0000 % BHARTI 3 03/31/20	1'300	0	0	1'300	CHF	107.25%	1'394'250.00	0.07
CH0234833678	1.5000 % ISHZ 1 1/2 02/14/19		700	0	700	CHF	103.05%	721'350.00	0.04
CH0235034110	1.1250 % ACACB 1 1/8 08/12/21 E	200	0	0	200	CHF	108.30%	216'600.00	0.01
CH0235475339	0.2500 % PFZENT 0 1/4 03/28/18 4	800	0	0	800	CHF	101.15%	809'200.00	0.04
CH0235475347	1.0000 % PFZENT 1 02/17/21 444	2'000	0	0	2'000	CHF	106.46%	2'129'200.00	0.11
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 4	1'650	0	0	1'650	CHF	116.74%	1'926'210.00	0.10
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24	1'000	0	0	1'000	CHF	114.40%	1'144'000.00	0.06
CH0236122724	1.3750 % SGSNVX 1 3/8 02/25/22	914	0	0	914	CHF	107.95%	986'663.00	0.05
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	1'210	0	0	1'210	CHF	113.00%	1'367'300.00	0.07
CH0236331127	1.1250 % EIBKOR 1 1/8 09/03/19 E	500	0	0	500	CHF	103.40%	517'000.00	0.03
CH0236516784	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 03/06/23	400	0	0	400	CHF	109.45%	437'800.00	0.02
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	400	0	0	400	CHF	122.95%	491'800.00	0.03
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	600	0	0	600	CHF	112.80%	676'800.00	0.04
CH0236686843	1.3750 % THURBK 1 3/8 08/28/23	660	0	0	660	CHF	111.30%	734'580.00	0.04
CH0236803992	1.0000 % COE 1 03/06/23 EMTN	350	0	0	350	CHF	110.25%	385'875.00	0.02
CH0237027252	0.6250 % SHBASS 0 5/8 12/11/18	2'380	0	0	2'380	CHF	102.20%	2'432'360.00	0.13

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0237552085	1.0000 % GIVNVX 1 09/18/20	250	0	0	250	CHF	104.55%	261'375.00	0.01
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	750	0	0	750	CHF	112.25%	841'875.00	0.04
CH0237639502	1.2500 % GS 1 1/4 09/11/19 EMTN	700	0	0	700	CHF	103.60%	725'200.00	0.04
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44	460	0	0	460	CHF	152.00%	699'200.00	0.04
CH0237650814	0.7500 % KBSCHW 0 3/4 03/12/20	900	0	0	900	CHF	103.70%	933'300.00	0.05
CH0238053091	1.0000 % BPLN 1 08/28/20	590	0	0	590	CHF	104.80%	618'320.00	0.03
CH0238053125	1.7500 % BPLN 1 3/4 02/28/24	820	0	0	820	CHF	113.70%	932'340.00	0.05
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EM	200	0	0	200	CHF	114.35%	228'700.00	0.01
CH0238315672	1.3750 % CCB 1 3/8 05/28/19 EMT	800	0	0	800	CHF	103.30%	826'400.00	0.04
CH0238315680	2.0000 % FRSRJ 2 05/28/19	500	0	0	500	CHF	101.00%	505'000.00	0.03
CH0238315698	1.0000 % BSAAN 1 05/28/20	600	0	0	600	CHF	104.20%	625'200.00	0.03
CH0238339433	1.2500 % BNCHIL 1 1/4 03/21/19	100	0	0	100	CHF	103.45%	103'450.00	0.01
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25	300	500	0	800	CHF	118.25%	946'000.00	0.05
CH0238841891	1.0000 % PSHYPO 1 01/14/22 590	2'000	0	0	2'000	CHF	107.45%	2'149'000.00	0.11
CH0239034314	0.8750 % KIWI 0 7/8 04/04/19	1'190	0	0	1'190	CHF	102.30%	1'217'370.00	0.06
CH0239193169	0.7500 % NDASS 0 3/4 10/04/19 E	1'450	0	0	1'450	CHF	102.70%	1'489'150.00	0.08
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	400	0	0	400	CHF	112.20%	448'800.00	0.02
CH0239322495	1.1250 % RABOBK 1 1/8 04/08/21	500	500	0	1'000	CHF	105.50%	1'055'000.00	0.06
CH0239498675	0.6250 % RY 0 5/8 04/09/19 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	102.35%	1'330'550.00	0.07
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	800	0	0	800	CHF	112.40%	899'200.00	0.05
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24	1'800	0	0	1'800	CHF	112.86%	2'031'480.00	0.11
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	800	0	0	800	CHF	104.50%	836'000.00	0.04
CH0240330016	1.0000 % ZURCTY 1 04/25/22	300	0	0	300	CHF	108.00%	324'000.00	0.02
CH0240623741	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/21/18 4	1'200	0	0	1'200	CHF	101.40%	1'216'800.00	0.06
CH0240623758	0.8750 % PFZENT 0 7/8 06/10/21 4	2'500	0	0	2'500	CHF	106.08%	2'652'000.00	0.14
CH0240672193	0.7500 % SYNNVX 0 3/4 11/01/19	775	0	0	775	CHF	102.10%	791'275.00	0.04
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	300	0	0	300	CHF	111.45%	334'350.00	0.02
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29		1'000	0	1'000	CHF	121.50%	1'215'000.00	0.06
CH0240907094	1.1250 % ABNANV 1 1/8 04/24/20	400	0	0	400	CHF	104.10%	416'400.00	0.02
CH0241392783	1.2500 % ACAFP 1 1/4 07/17/20 EM	900	0	0	900	CHF	104.80%	943'200.00	0.05
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMT	1'650	0	0	1'650	CHF	113.65%	1'875'225.00	0.10
CH0241530960	1.0000 % LAUSAN 1 04/29/22	800	0	0	800	CHF	107.45%	859'600.00	0.05
CH0241634929	0.7500 % MET 0 3/4 04/17/19 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	102.25%	1'022'500.00	0.05
CH0241926309	1.0000 % PSHYPO 1 05/10/22 592	250	0	0	250	CHF	107.76%	269'400.00	0.01
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25	650	0	0	650	CHF	115.35%	749'775.00	0.04
CH0242214853	1.3750 % BBVASM 1 3/8 05/09/17	185	0	0	185	CHF	101.31%	187'423.50	0.01
CH0242595277	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/06/20 4	2'100	0	0	2'100	CHF	103.44%	2'172'240.00	0.12
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 4	2'000	0	0	2'000	CHF	109.29%	2'185'800.00	0.12
CH0242984067	1.6250 % MOBNSW 1 5/8 05/19/21	500	0	0	500	CHF	106.90%	534'500.00	0.03
CH0243017081	1.1250 % JPM 1 1/8 11/06/20 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	105.05%	1'050'500.00	0.06
CH0243069256	1.1250 % BFCM 1 1/8 05/22/20 EM	900	0	0	900	CHF	103.85%	934'650.00	0.05
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	300	0	0	300	CHF	113.10%	339'300.00	0.02
CH0243069355	0.7500 % PM 0 3/4 12/16/19	250	0	0	250	CHF	103.20%	258'000.00	0.01
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	1'300	0	0	1'300	CHF	111.40%	1'448'200.00	0.08
CH0243154884	0.7500 % GRKPSW 0 3/4 05/07/21	1'100	0	0	1'100	CHF	106.00%	1'166'000.00	0.06
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 E	800	0	0	800	CHF	112.20%	897'600.00	0.05
CH0243273791	0.8750 % BOCOM 0 7/8 06/26/17 E	600	0	0	600	CHF	100.92%	605'520.00	0.03
CH0243483812	0.5000 % NYLIFE 0 1/2 05/13/19 G	1'500	0	0	1'500	CHF	101.95%	1'529'250.00	0.08
CH0243871735	1.0000 % VALIAN 1 11/22/19	400	0	0	400	CHF	103.15%	412'600.00	0.02
CH0244006414	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 10/05/21	800	0	0	800	CHF	106.46%	851'680.00	0.05
CH0244175201	1.2500 % KBFRIB 1 1/4 06/03/24	400	0	0	400	CHF	110.50%	442'000.00	0.02
CH0244653520	0.8750 % COOPSW 0 7/8 06/16/21	1'100	0	0	1'100	CHF	103.85%	1'142'350.00	0.06
CH0244692528	1.2500 % OERLSW 1 1/4 06/17/19	1'100	0	0	1'100	CHF	102.70%	1'129'700.00	0.06
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	1'200	0	0	1'200	CHF	115.50%	1'386'000.00	0.07

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.02.2016	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.07.2016	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
CH0244717978	1.5000 % AUCHAN 1 1/2 06/03/24	800	0	0	800	CHF	111.30%	890'400.00	0.05
CH0244830441	1.2500 % MIVIVI 1 1/4 06/13/18	190	0	0	190	CHF	101.25%	192'375.00	0.01
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	500	0	0	500	CHF	118.95%	594'750.00	0.03
CH0245138950	1.6250 % BANCOC 1 5/8 06/18/18	370	0	0	370	CHF	99.85%	369'445.00	0.02
CH0245146185	1.0000 % KBAARG 1 06/19/23	1'100	0	0	1'100	CHF	107.95%	1'187'450.00	0.06
CH0245536799	0.6250 % EUROF 0 5/8 06/30/21	1'000	0	0	1'000	CHF	105.10%	1'051'000.00	0.06
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	1'100	0	0	1'100	CHF	103.05%	1'133'550.00	0.06
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 4	1'150	0	0	1'150	CHF	119.10%	1'369'650.00	0.07
CH0245865834	1.0000 % NAB 1 12/10/21 GMTN	750	500	0	1'250	CHF	106.00%	1'325'000.00	0.07
CH0245865842	1.7500 % ACFP 1 3/4 06/27/22 EM	600	0	0	600	CHF	106.95%	641'700.00	0.03
CH0245865883	0.6250 % WSTP 0 5/8 09/02/20 EM	500	0	0	500	CHF	103.35%	516'750.00	0.03
CH0246788183	1.1250 % BCICI 1 1/8 06/26/19	700	0	0	700	CHF	102.50%	717'500.00	0.04
CH0246921537	1.1250 % ADUHOL 1 1/8 07/16/21	750	0	0	750	CHF	106.30%	797'250.00	0.04
CH0247163618	1.0000 % OPBANK 1 07/14/21 EMT	1'650	0	0	1'650	CHF	105.75%	1'744'875.00	0.09
CH0247611251	0.6250 % ZURNVX 0 5/8 07/22/20	600	500	0	1'100	CHF	102.65%	1'129'150.00	0.06
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	1'000	0	2'000	CHF	114.25%	2'285'000.00	0.12
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	1'300	0	0	1'300	CHF	121.80%	1'583'400.00	0.08
CH0247776138	1.5000 % SCMNIX 1 1/2 07/14/26	1'400	0	0	1'400	CHF	113.40%	1'587'600.00	0.08
CH0247849992	1.0000 % PSHYPO 1 03/21/23 595	1'200	0	0	1'200	CHF	108.52%	1'302'240.00	0.07
CH0247902890	1.0000 % TOTAL 1 08/29/24 EMTN	2'300	0	0	2'300	CHF	108.85%	2'503'550.00	0.13
CH0247902908	0.6250 % WFC 0 5/8 09/03/20 EMT	700	0	0	700	CHF	103.15%	722'050.00	0.04
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMT	900	0	0	900	CHF	109.60%	986'400.00	0.05
CH0247904557	1.0000 % POLAND 1 09/17/21 EMT	1'975	0	0	1'975	CHF	104.95%	2'072'762.50	0.11
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMT		700	0	700	CHF	111.10%	777'700.00	0.04
CH0248204627	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/15/19 4	1'360	0	0	1'360	CHF	102.00%	1'387'200.00	0.07
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	990	0	0	990	CHF	109.02%	1'079'298.00	0.06
CH0248259456	0.7500 % CS 0 3/4 07/11/19	2'100	1'000	0	3'100	CHF	102.20%	3'168'200.00	0.17
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	900	0	0	900	CHF	99.05%	891'450.00	0.05
CH0248890573	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 08/21/19	1'380	0	0	1'380	CHF	101.90%	1'406'220.00	0.07
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	2'800	0	0	2'800	CHF	109.50%	3'066'000.00	0.16
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	1'000	1'000	0	2'000	CHF	108.80%	2'176'000.00	0.12
CH0251429384	0.6250 % TESSIN 0 5/8 05/09/22	450	0	0	450	CHF	105.70%	475'650.00	0.03
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 E	500	0	0	500	CHF	109.85%	549'250.00	0.03
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	850	500	0	1'350	CHF	113.10%	1'526'850.00	0.08
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'400	0	0	1'400	CHF	119.20%	1'668'800.00	0.09
CH0252511925	0.8750 % LANSBK 0 7/8 09/16/24 E	270	0	0	270	CHF	108.75%	293'625.00	0.02
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	1'300	0	0	1'300	CHF	101.30%	1'316'900.00	0.07
CH0252740250	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 09/09/22	2'400	0	0	2'400	CHF	104.95%	2'518'800.00	0.13
CH0252903684	0.5000 % KTBL 0 1/2 03/30/22	1'250	0	0	1'250	CHF	105.50%	1'318'750.00	0.07
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	1'400	0	0	1'400	CHF	112.75%	1'578'500.00	0.08
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	1'400	0	0	1'400	CHF	125.00%	1'750'000.00	0.09
CH0253225921	0.5000 % EBN 0 1/2 09/22/22	325	0	0	325	CHF	105.15%	341'737.50	0.02
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	500	0	0	500	CHF	110.75%	553'750.00	0.03
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	500	0	0	500	CHF	108.70%	543'500.00	0.03
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	800	0	0	800	CHF	116.50%	932'000.00	0.05
CH0253514753	0.6250 % BATSLN 0 5/8 09/08/21 E	1'400	0	0	1'400	CHF	103.85%	1'453'900.00	0.08
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 E	1'100	0	0	1'100	CHF	112.90%	1'241'900.00	0.07
CH0253592734	1.3750 % CRHID 1 3/8 09/30/22	1'400	0	0	1'400	CHF	106.30%	1'488'200.00	0.08
CH0253592767	1.6250 % IMPNSW 1 5/8 10/15/24	800	0	0	800	CHF	108.40%	867'200.00	0.05
CH0253609082	0.1250 % PFZENT 0 1/8 05/15/19 4	3'000	0	0	3'000	CHF	101.55%	3'046'500.00	0.16
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 4	1'450	0	0	1'450	CHF	107.51%	1'558'895.00	0.08
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	600	0	0	600	CHF	111.40%	668'400.00	0.04
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	500	150	0	650	CHF	116.95%	760'175.00	0.04
CH0253613530	0.6250 % BUCNSW 0 5/8 10/02/20	500	0	0	500	CHF	101.45%	507'250.00	0.03

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	500	0	0	500	CHF	107.80%	539'000.00	0.03
CH0254147504	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 09/28/29	500	0	0	500	CHF	118.75%	593'750.00	0.03
CH0254212225	0.3750 % ZURICH 0 3/8 10/06/21	500	0	0	500	CHF	104.95%	524'750.00	0.03
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	600	0	0	600	CHF	115.60%	693'600.00	0.04
CH0254281634	1.0000 % ICBAS 1 12/17/19	600	0	0	600	CHF	102.50%	615'000.00	0.03
CH0254281642	0.7500 % KORESC 0 3/4 11/12/19	700	0	0	700	CHF	101.95%	713'650.00	0.04
CH0254281659	0.5000 % CABEI 0 1/2 11/26/18	900	0	0	900	CHF	101.25%	911'250.00	0.05
CH0254282202	1.0000 % MET 1 09/19/22 0000	1'500	0	0	1'500	CHF	107.50%	1'612'500.00	0.09
CH0254284778	1.0000 % COOPSW 1 09/29/23	500	0	0	500	CHF	105.75%	528'750.00	0.03
CH0254849513	0.6250 % ZUGKAN 0 5/8 10/17/22	300	0	0	300	CHF	105.00%	315'000.00	0.02
CH0254859116	1.0000 % CS 1 09/24/21 EMTN	1'300	1'500	0	2'800	CHF	104.10%	2'914'800.00	0.16
CH0255191709	0.5000 % HYUCAP 0 1/2 10/20/17	200	0	0	200	CHF	100.58%	201'160.00	0.01
CH0255286707	0.7500 % BPLN 0 3/4 09/27/21 EM	1'700	0	0	1'700	CHF	103.90%	1'766'300.00	0.09
CH0255287010	0.7500 % CMBNSW 0 3/4 10/14/19	400	0	0	400	CHF	102.05%	408'200.00	0.02
CH0255287028	1.2500 % CMBNSW 1 1/4 10/14/22	400	0	0	400	CHF	106.40%	425'600.00	0.02
CH0255475284	0.5000 % LISNSW 0 1/2 10/08/20	500	0	0	500	CHF	103.15%	515'750.00	0.03
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	515	0	0	515	CHF	108.95%	561'092.50	0.03
CH0255590801	1.0000 % ACAFP 1 10/08/21 EMTN	1'350	0	0	1'350	CHF	105.10%	1'418'850.00	0.08
CH0255678325	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/02/21	1'300	0	0	1'300	CHF	103.74%	1'348'620.00	0.07
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	550	0	0	550	CHF	110.56%	608'080.00	0.03
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32	1'000	0	0	1'000	CHF	120.99%	1'209'900.00	0.06
CH0255893049	1.2500 % GLENLN 1 1/4 12/01/20 E	1'900	0	0	1'900	CHF	100.50%	1'909'500.00	0.10
CH0255893056	1.1250 % CABEI 1 1/8 02/24/23	150	0	0	150	CHF	106.30%	159'450.00	0.01
CH0255893064	0.5000 % WSTP 0 1/2 02/02/22 GM	1'200	0	0	1'200	CHF	103.25%	1'239'000.00	0.07
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 E	400	350	0	750	CHF	108.30%	812'250.00	0.04
CH0255893114	0.7500 % HELNSW 0 3/4 10/28/20	820	0	0	820	CHF	102.90%	843'780.00	0.04
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	700	0	0	700	CHF	112.90%	790'300.00	0.04
CH0255896190	0.3750 % THURBK 0 3/8 10/23/20	1'100	0	0	1'100	CHF	103.50%	1'138'500.00	0.06
CH0256434595	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/21/20 4	2'690	0	0	2'690	CHF	102.50%	2'757'250.00	0.15
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 4	2'300	0	0	2'300	CHF	107.60%	2'474'800.00	0.13
CH0257042165	1.0000 % SPSNSW 1 12/10/19	200	0	0	200	CHF	102.45%	204'900.00	0.01
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	500	0	0	500	CHF	110.80%	554'000.00	0.03
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	700	0	0	700	CHF	107.95%	755'650.00	0.04
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	1'100	0	0	1'100	CHF	109.25%	1'201'750.00	0.06
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24	2'100	0	0	2'100	CHF	107.65%	2'260'650.00	0.12
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35	470	0	0	470	CHF	126.58%	594'926.00	0.03
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 4	310	500	0	810	CHF	116.20%	941'220.00	0.05
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMT	900	0	0	900	CHF	115.40%	1'038'600.00	0.06
CH0260296618	0.8750 % BCICI 0 7/8 11/23/18	400	0	0	400	CHF	100.85%	403'400.00	0.02
CH0260496283	0.8750 % NONGNO 0 7/8 12/02/20	400	0	0	400	CHF	103.20%	412'800.00	0.02
CH0260515751	0.3750 % SOLEUR 0 3/8 12/15/21	300	0	0	300	CHF	104.65%	313'950.00	0.02
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	260	500	0	760	CHF	107.80%	819'280.00	0.04
CH0260769382	0.5000 % T 0 1/2 12/04/19	1'800	0	0	1'800	CHF	101.70%	1'830'600.00	0.10
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	1'900	0	0	1'900	CHF	110.90%	2'107'100.00	0.11
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	400	0	0	400	CHF	116.35%	465'400.00	0.02
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	350	0	0	350	CHF	106.75%	373'625.00	0.02
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	900	0	0	900	CHF	107.85%	970'650.00	0.05
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	700	0	0	700	CHF	107.05%	749'350.00	0.04
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40	725	0	0	725	CHF	131.19%	951'127.50	0.05
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	1'300	0	0	1'300	CHF	110.35%	1'434'550.00	0.08
CH0262286237	0.3750 % WKBNSW 0 3/8 12/15/21	800	2'000	0	2'800	CHF	102.65%	2'874'200.00	0.15
CH0262286252	0.6250 % WKBNSW 0 5/8 12/15/23	250	0	0	250	CHF	105.00%	262'500.00	0.01
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	1'000	0	0	1'000	CHF	107.75%	1'077'500.00	0.06
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	450	0	0	450	CHF	108.30%	487'350.00	0.03

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0262883363	0.6250 % ACAFP 0 5/8 09/15/23 EM	1'200	0	0	1'200	CHF	102.60%	1'231'200.00	0.07
CH0262888933	0.5000 % VBPSW 0 1/2 04/07/21	350	0	0	350	CHF	102.15%	357'525.00	0.02
CH0262888941	0.8750 % VBPSW 0 7/8 10/07/24	350	0	0	350	CHF	104.80%	366'800.00	0.02
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 4	1'400	2'000	0	3'400	CHF	105.50%	3'587'000.00	0.19
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	2'800	150	0	2'950	CHF	112.28%	3'312'260.00	0.18
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25	2'800	2'000	0	4'800	CHF	106.60%	5'116'800.00	0.27
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	1'450	0	0	1'450	CHF	105.35%	1'527'575.00	0.08
CH0266153656	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 01/28/21	900	0	0	900	CHF	103.20%	928'800.00	0.05
CH0266437950	0.3750 % KBLUZE 0 3/8 01/30/23	2'300	1'000	0	3'300	CHF	103.80%	3'425'400.00	0.18
CH0266836128	0.1250 % ENGAKR 0 1/8 03/02/22	200	0	0	200	CHF	99.30%	198'600.00	0.01
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	400	0	0	400	CHF	103.60%	414'400.00	0.02
CH0266842696	0.3750 % ACAFP 0 3/8 01/27/20 EM	150	0	0	150	CHF	101.40%	152'100.00	0.01
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	105.05%	1'050'500.00	0.06
CH0267020045	0.3750 % NYLIFE 0 3/8 02/02/22 G	1'800	0	0	1'800	CHF	103.50%	1'863'000.00	0.10
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30	750	2'700	0	3'450	CHF	104.74%	3'613'530.00	0.19
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	900	0	0	900	CHF	103.50%	931'500.00	0.05
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	350	0	0	350	CHF	111.60%	390'600.00	0.02
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	350	0	0	350	CHF	101.55%	355'425.00	0.02
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	550	0	0	550	CHF	108.90%	598'950.00	0.03
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 4	3'300	150	0	3'450	CHF	107.94%	3'723'930.00	0.20
CH0268988174	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 04/17/23	800	1'500	0	2'300	CHF	101.70%	2'339'100.00	0.12
CH0268988182	1.0000 % SCMNVX 1 04/17/35	650	0	0	650	CHF	112.45%	730'925.00	0.04
CH0269382088	0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30	2'700	0	0	2'700	CHF	105.40%	2'845'800.00	0.15
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	1'000	0	0	1'000	CHF	103.70%	1'037'000.00	0.06
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	700	0	0	700	CHF	103.35%	723'450.00	0.04
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	350	0	0	350	CHF	104.70%	366'450.00	0.02
CH0269836703	0.6250 % MQGAU 0 5/8 09/04/23 E	565	0	0	565	CHF	103.45%	584'492.50	0.03
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	700	0	0	700	CHF	102.55%	717'850.00	0.04
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	650	800	0	1'450	CHF	104.10%	1'509'450.00	0.08
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	200	0	0	200	CHF	108.00%	216'000.00	0.01
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	1'700	0	0	1'700	CHF	115.90%	1'970'300.00	0.10
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	250	0	0	250	CHF	125.00%	312'500.00	0.02
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMT	400	0	0	400	CHF	102.45%	409'800.00	0.02
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	1'300	0	0	1'300	CHF	108.25%	1'407'250.00	0.07
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	5'400	0	0	5'400	CHF	104.25%	5'629'500.00	0.30
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	1'650	150	0	1'800	CHF	109.00%	1'962'000.00	0.10
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28	600	2'350	0	2'950	CHF	105.75%	3'119'625.00	0.17
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35	2'400	0	0	2'400	CHF	114.22%	2'741'280.00	0.15
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	400	0	0	400	CHF	104.75%	419'000.00	0.02
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	800	0	0	800	CHF	105.20%	841'600.00	0.04
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMT	2'100	0	0	2'100	CHF	103.35%	2'170'350.00	0.12
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'400	0	0	1'400	CHF	122.00%	1'708'000.00	0.09
CH0273037892	0.2500 % WKBNSW 0 1/4 03/16/23	900	0	0	900	CHF	102.25%	920'250.00	0.05
CH0273347820	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 03/31/21	250	0	0	250	CHF	102.85%	257'125.00	0.01
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	350	500	0	850	CHF	109.35%	929'475.00	0.05
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 4	600	0	0	600	CHF	104.55%	627'300.00	0.03
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 4	1'400	150	0	1'550	CHF	108.15%	1'676'325.00	0.09
CH0273755824	0.2300 % SWAUTO 0.23 03/25/19	1'200	0	0	1'200	CHF	100.75%	1'209'000.00	0.06
CH0273761350	0.1500 % WINCTY 0.15 03/27/23	400	0	0	400	CHF	101.90%	407'600.00	0.02
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	1'150	0	0	1'150	CHF	97.30%	1'118'950.00	0.06
CH0274253514	0.6000 % KBFRIB 0.6 04/09/27	700	0	0	700	CHF	105.85%	740'950.00	0.04
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	900	0	0	900	CHF	107.95%	971'550.00	0.05
CH0274740262	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/31/21 134	1'150	0	0	1'150	CHF	102.50%	1'178'750.00	0.06
CH0274758827	0.6250 % MDLZ 0 5/8 12/30/21	1'000	0	0	1'000	CHF	102.75%	1'027'500.00	0.05

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	1'250	0	0	1'250	CHF	106.60%	1'332'500.00	0.07
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	250	0	0	250	CHF	103.65%	259'125.00	0.01
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	500	0	0	500	CHF	107.00%	535'000.00	0.03
CH0276237648	0.0500 % GEBNVX 0.05 04/17/19	400	0	0	400	CHF	100.45%	401'800.00	0.02
CH0276237663	0.3000 % GEBNVX 0.3 04/17/23	700	0	0	700	CHF	102.50%	717'500.00	0.04
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	850	0	0	850	CHF	107.00%	909'500.00	0.05
CH0276581110	0.1940 % CABEI 0.194 11/19/21 EM	600	0	0	600	CHF	100.25%	601'500.00	0.03
CH0276801450	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 01/25/19	500	0	0	500	CHF	101.42%	507'100.00	0.03
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	3'500	500	0	4'000	CHF	99.70%	3'988'000.00	0.21
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	140	450	0	590	CHF	106.05%	625'695.00	0.03
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 4	1'000	0	0	1'000	CHF	102.51%	1'025'100.00	0.05
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 4	1'600	0	0	1'600	CHF	106.50%	1'704'000.00	0.09
CH0278875940	0.6250 % FGBUH 0 5/8 05/27/22	400	0	0	400	CHF	101.70%	406'800.00	0.02
CH0278875965	0.2500 % BCICI 0 1/4 06/17/20	500	0	0	500	CHF	100.05%	500'250.00	0.03
CH0278875973	0.3750 % WFC 0 3/8 06/02/22 EMT	1'000	0	0	1'000	CHF	102.80%	1'028'000.00	0.05
CH0279135310	0.2500 % SGSNVX 0 1/4 05/08/23	1'400	0	0	1'400	CHF	101.45%	1'420'300.00	0.08
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	1'000	150	0	1'150	CHF	108.95%	1'252'925.00	0.07
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	450	0	0	450	CHF	102.60%	461'700.00	0.02
CH0279929712	0.1500 % KBAARG 0.15 05/18/22	450	1'000	0	1'450	CHF	102.00%	1'479'000.00	0.08
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	450	0	0	450	CHF	112.70%	507'150.00	0.03
CH0280567469	0.3750 % BSANCI 0 3/8 05/19/22	400	0	0	400	CHF	99.05%	396'200.00	0.02
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23	550	0	0	550	CHF	102.57%	564'135.00	0.03
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34	2'250	0	0	2'250	CHF	109.20%	2'457'000.00	0.13
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	700	0	0	700	CHF	103.50%	724'500.00	0.04
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	1'150	0	0	1'150	CHF	106.30%	1'222'450.00	0.07
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	700	0	0	700	CHF	105.75%	740'250.00	0.04
CH0281864493	1.6250 % BSTDBK 1 5/8 12/20/19	600	0	0	600	CHF	102.65%	615'900.00	0.03
CH0282018974	0.7600 % SINOCH 0.76 06/17/22 E	1'100	0	0	1'100	CHF	101.95%	1'121'450.00	0.06
CH0282018982	0.5000 % TOTAL 0 1/2 06/01/27 E	700	0	0	700	CHF	104.75%	733'250.00	0.04
CH0282018990	0.2500 % BZLNZ 0 1/4 06/24/22 GM	1'000	1'000	0	2'000	CHF	101.90%	2'038'000.00	0.11
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	550	0	0	550	CHF	106.90%	587'950.00	0.03
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMT	750	0	0	750	CHF	103.05%	772'875.00	0.04
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	750	0	0	750	CHF	104.05%	780'375.00	0.04
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37	2'200	350	0	2'550	CHF	114.88%	2'929'440.00	0.16
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	900	900	0	1'800	CHF	122.30%	2'201'400.00	0.12
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	550	0	0	550	CHF	104.60%	575'300.00	0.03
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	750	0	0	750	CHF	112.00%	840'000.00	0.04
CH0282857892	0.1800 % SCARD 0.18 06/15/18 A	825	0	0	825	CHF	100.15%	826'237.50	0.04
CH0282857926	0.3400 % SCARD 0.34 06/15/20 A	700	0	0	700	CHF	100.90%	706'300.00	0.04
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	550	0	0	550	CHF	103.90%	571'450.00	0.03
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	1'800	0	0	1'800	CHF	105.10%	1'891'800.00	0.10
CH0284415681	0.5500 % NDASS 0.55 06/23/25 EM	1'850	0	0	1'850	CHF	104.40%	1'931'400.00	0.10
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25	2'300	0	0	2'300	CHF	105.42%	2'424'660.00	0.13
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	1'900	0	0	1'900	CHF	114.54%	2'176'260.00	0.12
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42	800	0	0	800	CHF	123.50%	988'000.00	0.05
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	300	0	0	300	CHF	105.85%	317'550.00	0.02
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	1'100	0	0	1'100	CHF	122.20%	1'344'200.00	0.07
CH0285509334	2.1250 % ALPHSW 2 1/8 06/30/23	550	0	0	550	CHF	98.65%	542'575.00	0.03
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27	600	0	0	600	CHF	110.60%	663'600.00	0.04
CH0285849359	0.3750 % PFZENT 0 3/8 08/30/23 4	2'950	0	0	2'950	CHF	104.35%	3'078'325.00	0.16
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 4	1'100	0	0	1'100	CHF	107.12%	1'178'320.00	0.06
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	1'000	0	0	1'000	CHF	107.20%	1'072'000.00	0.06
CH0287817842	0.2500 % COOPSW 0 1/4 07/31/20	1'250	0	0	1'250	CHF	101.05%	1'263'125.00	0.07
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	1'000	0	0	1'000	CHF	104.45%	1'044'500.00	0.06

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 4	500	0	0	500	CHF	105.50%	527'500.00	0.03
CH0289316397	0.3500 % NAB 0.35 08/05/22 GMT	900	0	0	900	CHF	102.75%	924'750.00	0.05
CH0290007134	0.3750 % KBBS 0 3/8 08/10/23	1'300	0	0	1'300	CHF	103.60%	1'346'800.00	0.07
CH0290876496	0.5000 % KWLILI 0 1/2 09/09/21	800	0	0	800	CHF	100.75%	806'000.00	0.04
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26	3'800	0	0	3'800	CHF	104.53%	3'972'140.00	0.21
CH0292086193	0.4500 % CAF 0.45 09/07/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	103.50%	517'500.00	0.03
CH0292086714	0.5500 % ACAFP 0.55 09/01/22 EM	500	0	0	500	CHF	102.75%	513'750.00	0.03
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	300	0	0	300	CHF	110.75%	332'250.00	0.02
CH0292774657	0.6250 % CS 0 5/8 08/21/20 EMTN	1'900	0	0	1'900	CHF	100.15%	1'902'850.00	0.10
CH0292877880	0.3750 % RDSALN 0 3/8 08/21/23 E	2'800	0	0	2'800	CHF	103.85%	2'907'800.00	0.15
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 E	2'000	500	0	2'500	CHF	110.85%	2'771'250.00	0.15
CH0292984447	0.5000 % SANSFC 0 1/2 10/05/20 E	500	0	0	500	CHF	100.00%	500'000.00	0.03
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EM	300	0	0	300	CHF	107.45%	322'350.00	0.02
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	700	0	0	700	CHF	102.55%	717'850.00	0.04
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31	500	0	0	500	CHF	108.45%	542'250.00	0.03
CH0293173453	1.2500 % LONNVX 1 1/4 09/22/23	500	0	0	500	CHF	105.50%	527'500.00	0.03
CH0293343395	0.0800 % WKBNSW 0.08 09/15/21	750	0	0	750	CHF	101.25%	759'375.00	0.04
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	500	0	0	500	CHF	103.55%	517'750.00	0.03
CH0295050915	0.5000 % CMBNSW 0 1/2 09/15/21	500	0	0	500	CHF	101.50%	507'500.00	0.03
CH0295186370	0.0000 % PFZENT 0 07/15/20 468	700	1'700	0	2'400	CHF	101.75%	2'442'000.00	0.13
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 4	1'500	0	0	1'500	CHF	104.50%	1'567'500.00	0.08
CH0295653577	0.3000 % BNS 0.3 09/16/22 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	102.85%	1'645'600.00	0.09
CH0296231951	0.3500 % NIEDOE 0.35 09/22/23	900	1'000	0	1'900	CHF	104.00%	1'976'000.00	0.11
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25	1'600	0	0	1'600	CHF	104.32%	1'669'120.00	0.09
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	700	0	0	700	CHF	116.59%	816'130.00	0.04
CH0297343557	0.0000 % SOLEUR 0 10/16/23	500	0	0	500	CHF	102.50%	512'500.00	0.03
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	900	0	0	900	CHF	108.75%	978'750.00	0.05
CH0297974880	0.2500 % KO 0 1/4 12/22/22	2'000	0	0	2'000	CHF	104.30%	2'086'000.00	0.11
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	2'100	0	0	2'100	CHF	111.95%	2'350'950.00	0.13
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	500	0	0	500	CHF	109.20%	546'000.00	0.03
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMT	1'700	0	0	1'700	CHF	104.00%	1'768'000.00	0.09
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	900	0	0	900	CHF	105.35%	948'150.00	0.05
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	500	500	0	1'000	CHF	102.85%	1'028'500.00	0.05
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 4	2'150	0	0	2'150	CHF	102.50%	2'203'750.00	0.12
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 4	2'250	1'800	0	4'050	CHF	108.43%	4'391'415.00	0.23
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25		500	0	500	CHF	106.00%	530'000.00	0.03
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29	1'050	2'000	0	3'050	CHF	106.14%	3'237'270.00	0.17
CH0302790115	0.2500 % NDASS 0 1/4 11/27/23 E	1'000	2'000	0	3'000	CHF	102.20%	3'066'000.00	0.16
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	200	0	0	200	CHF	102.20%	204'400.00	0.01
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EM	700	0	0	700	CHF	103.80%	726'600.00	0.04
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'300	0	0	1'300	CHF	105.25%	1'368'250.00	0.07
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EM	700	0	0	700	CHF	101.55%	710'850.00	0.04
CH0304055806	0.2000 % SWICAR 0.2 11/19/18	1'100	0	0	1'100	CHF	100.40%	1'104'400.00	0.06
CH0304749218	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 12/16/22	700	0	0	700	CHF	102.30%	716'100.00	0.04
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34	2'100	0	0	2'100	CHF	111.83%	2'348'430.00	0.12
CH0304966960	0.0500 % KBAARG 0.05 12/16/22	700	0	0	700	CHF	101.60%	711'200.00	0.04
CH0305117886	1.5000 % PEMEX 1 1/2 12/08/20 E	2'000	0	0	2'000	CHF	101.30%	2'026'000.00	0.11
CH0305186535	0.0400 % ZKB 0.04 12/09/22 136		1'000	0	1'000	CHF	101.60%	1'016'000.00	0.05
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 E	500	500	0	1'000	CHF	106.75%	1'067'500.00	0.06
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	700	0	0	700	CHF	104.95%	734'650.00	0.04
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	1'750	0	0	1'750	CHF	104.30%	1'825'250.00	0.10
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	350	250	0	600	CHF	112.50%	675'000.00	0.04
CH0306173722	0.0000 % PFZENT 0 07/25/23 472	800	1'500	0	2'300	CHF	101.57%	2'336'110.00	0.12
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 4	350	0	0	350	CHF	101.71%	355'985.00	0.02

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
		01.02.2016			31.07.2016				
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 4	500	0	0	500	CHF	106.45%	532'250.00	0.03
CH0306179091	0.3750 % LHN VX 0 3/8 12/03/21	900	0	0	900	CHF	101.30%	911'700.00	0.05
CH0306179125	1.0000 % LHN VX 1 12/04/25	600	0	0	600	CHF	104.75%	628'500.00	0.03
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	700	0	0	700	CHF	104.95%	734'650.00	0.04
CH0306770600	0.3750 % WSTP 0 3/8 02/05/24 EM	700	0	0	700	CHF	102.75%	719'250.00	0.04
CH0307256377	0.0000 % PFZENT 0 07/25/23 FEB	1'500	0	1'500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0307256401	0.0300 % ZKB 0.03 02/11/22 137	1'000	0	0	1'000	CHF	101.45%	1'014'500.00	0.05
CH0307256419	0.0000 % SCHWYZ 0 01/20/23	350	0	0	350	CHF	102.65%	359'275.00	0.02
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 4	800	1'600	0	2'400	CHF	103.00%	2'472'000.00	0.13
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	700	0	0	700	CHF	102.90%	720'300.00	0.04
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 47	1'300	0	0	1'300	CHF	109.24%	1'420'120.00	0.08
CH0309761853	0.2500 % NAB 0 1/4 01/19/23 GMT	800	0	0	800	CHF	101.75%	814'000.00	0.04
CH0310175507	0.0000 % KTBS 0 01/28/22	700	0	0	700	CHF	102.70%	718'900.00	0.04
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 E	1'000	0	0	1'000	CHF	104.35%	1'043'500.00	0.06
CH0310175549	0.6500 % MDLZ 0.65 07/26/22	600	900	0	1'500	CHF	102.30%	1'534'500.00	0.08
CH0310175556	0.0000 % PSHYPO 0 01/09/20 624	300	0	0	300	CHF	101.60%	304'800.00	0.02
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26	500	0	0	500	CHF	103.03%	515'150.00	0.03
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EM	700	0	0	700	CHF	105.10%	735'700.00	0.04
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EM		700	0	700	CHF	101.55%	710'850.00	0.04
CH0310451833	0.1500 % CAF 0.15 02/24/22 EMTN		550	0	550	CHF	101.25%	556'875.00	0.03
CH0310451841	0.7500 % UBS 0 3/4 02/22/22		1'000	0	1'000	CHF	102.55%	1'025'500.00	0.05
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26		800	0	800	CHF	105.20%	841'600.00	0.04
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	700	0	0	700	CHF	105.20%	736'400.00	0.04
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24	1'000	0	0	1'000	CHF	102.95%	1'029'500.00	0.05
CH0311427618	0.2000 % WKBNSW 0.2 08/19/24	500	0	0	500	CHF	101.80%	509'000.00	0.03
CH0311427626	0.3710 % CABEI 0.371 08/26/22 EM		1'200	0	1'200	CHF	101.85%	1'222'200.00	0.06
CH0311427659	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28		350	350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0311427667	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37		350	350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0311427675	0.5500 % GS 0.55 09/09/21 EMTN		1'000	0	1'000	CHF	102.60%	1'026'000.00	0.05
CH0312203851	0.0000 % KBBL 0 04/20/20		600	0	600	CHF	101.00%	606'000.00	0.03
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28		600	0	600	CHF	102.10%	612'600.00	0.03
CH0312512681	0.6250 % BELL SW 0 5/8 03/24/25		1'200	0	1'200	CHF	104.20%	1'250'400.00	0.07
CH0312512699	0.0000 % PFZENT 0 12/15/21 477		1'800	0	1'800	CHF	101.93%	1'834'740.00	0.10
CH0312512707	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 M		1'600	1'600	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 4		1'900	0	1'900	CHF	106.95%	2'032'050.00	0.11
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24		500	0	500	CHF	102.25%	511'250.00	0.03
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54		900	0	900	CHF	106.50%	958'500.00	0.05
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	500	0	0	500	CHF	103.60%	518'000.00	0.03
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23		3'200	0	3'200	CHF	102.50%	3'280'000.00	0.17
CH0314250983	0.0000 % KBAARG 0 03/08/22		350	0	350	CHF	101.05%	353'675.00	0.02
CH0315593860	0.3000 % ABNANV 0.3 12/18/24 EM		700	0	700	CHF	101.80%	712'600.00	0.04
CH0315593894	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28		1'350	1'350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0315593902	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30		2'200	2'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0315593910	0.5500 % BANQUE 0.55 10/11/22 E		400	0	400	CHF	101.65%	406'600.00	0.02
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36		1'350	0	1'350	CHF	105.70%	1'426'950.00	0.08
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMT		350	0	350	CHF	101.00%	353'500.00	0.02
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN		350	0	350	CHF	102.90%	360'150.00	0.02
CH0316423265	0.3000 % NONGNO 0.3 09/16/22 E		350	0	350	CHF	100.40%	351'400.00	0.02
CH0316994638	0.6000 % SANS CF 0.6 03/23/21 EM		350	0	350	CHF	101.55%	355'425.00	0.02
CH0316994661	1.0000 % IMPNSW 1 03/20/26		150	0	150	CHF	103.90%	155'850.00	0.01
CH0317921663	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 03/31/28		500	0	500	CHF	103.70%	518'500.00	0.03
CH0318407761	0.3500 % MINGNO 0.35 04/05/23 E		500	0	500	CHF	101.80%	509'000.00	0.03
CH0319403702	1.5000 % KWLILI 1 1/2 12/06/22		900	0	900	CHF	103.10%	927'900.00	0.05
CH0319403736	0.0000 % PFZENT 0 11/07/22 479		1'200	0	1'200	CHF	101.76%	1'221'120.00	0.06

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.02.2016	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.07.2016	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 4		2'050	0	2'050	CHF	101.35%	2'077'675.00	0.11
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138		1'100	0	1'100	CHF	101.80%	1'119'800.00	0.06
CH0319403769	0.2500 % NIDKBK 0 1/4 05/27/26		350	0	350	CHF	102.40%	358'400.00	0.02
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26		400	0	400	CHF	102.60%	410'400.00	0.02
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 48		1'400	0	1'400	CHF	103.90%	1'454'600.00	0.08
CH0319415912	0.0000 % PSHYPO 0 07/02/21 626		1'400	0	1'400	CHF	101.93%	1'427'020.00	0.08
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28		500	0	500	CHF	101.24%	506'200.00	0.03
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32		1'000	0	1'000	CHF	104.67%	1'046'700.00	0.06
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35		3'100	0	3'100	CHF	107.65%	3'337'150.00	0.18
CH0319415953	0.5500 % CS 0.55 04/15/24 EMTN		1'200	0	1'200	CHF	101.40%	1'216'800.00	0.06
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26		1'250	0	1'250	CHF	104.60%	1'307'500.00	0.07
CH0319415979	1.7500 % GRANDX 1 3/4 05/12/22		500	0	500	CHF	104.80%	524'000.00	0.03
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26		1'450	0	1'450	CHF	101.35%	1'469'575.00	0.08
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN		1'200	0	1'200	CHF	102.25%	1'227'000.00	0.07
CH0319416001	2.2500 % GLENLN 2 1/4 05/10/21 E		500	0	500	CHF	104.55%	522'750.00	0.03
CH0319932767	0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31		1'100	0	1'100	CHF	102.75%	1'130'250.00	0.06
CH0320297895	0.7500 % DB 0 3/4 07/05/21 EMTN		900	0	900	CHF	99.80%	898'200.00	0.05
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25		1'000	0	1'000	CHF	102.55%	1'025'500.00	0.05
CH0320712604	0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31		450	0	450	CHF	106.00%	477'000.00	0.03
CH032344010X	0.3000 % SWICAR 0.3 04/18/20		1'700	0	1'700	CHF	100.45%	1'707'650.00	0.09
CH0323440112	1.6250 % AKEB 1 5/8 06/09/23		600	0	600	CHF	102.20%	613'200.00	0.03
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31		700	0	700	CHF	103.75%	726'250.00	0.04
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN		1'100	0	1'100	CHF	102.05%	1'122'550.00	0.06
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN		1'700	0	1'700	CHF	104.40%	1'774'800.00	0.09
CH0323735610	0.0000 % PSHYPO 0 07/05/22 630		2'500	0	2'500	CHF	101.91%	2'547'750.00	0.14
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27		500	0	500	CHF	101.65%	508'250.00	0.03
CH0323735636	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35		1'200	1'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0323735651	1.5000 % PEMEX 1 1/2 06/14/18 E		700	0	700	CHF	102.00%	714'000.00	0.04
CH0323735669	2.3750 % PEMEX 2 3/8 12/14/21 E		600	0	600	CHF	105.20%	631'200.00	0.03
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EM		350	0	350	CHF	103.95%	363'825.00	0.02
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMT		1'300	0	1'300	CHF	102.00%	1'326'000.00	0.07
CH0325429196	1.3750 % NIBCAP 1 3/8 06/17/19 E		350	0	350	CHF	101.35%	354'725.00	0.02
CH0326213938	0.0000 % PFZENT 0 07/15/20 468R		1'700	1'700	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0326213946	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 4		1'200	1'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0326213987	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 48		900	900	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH032637138X	0.1300 % SCARD 0.13 06/15/19 A		380	0	380	CHF	100.30%	381'140.00	0.02
CH0326371413	0.7500 % FIDISI 0 3/4 11/29/21		600	0	600	CHF	101.10%	606'600.00	0.03
CH0326371421	1.0000 % HIAGSW 1 07/04/23		700	0	700	CHF	101.30%	709'100.00	0.04
CH0326371439	0.2500 % COOPSW 0 1/4 09/30/22		250	0	250	CHF	100.90%	252'250.00	0.01
CH0326371447	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26		350	350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0326371454	0.3750 % SUNSW 0 3/8 07/11/22		1'300	0	1'300	CHF	100.40%	1'305'200.00	0.07
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26		700	0	700	CHF	100.85%	705'950.00	0.04
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28		185	0	185	CHF	103.05%	190'642.50	0.01
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 E		600	0	600	CHF	102.20%	613'200.00	0.03
CH0328298044	0.0000 % PSHYPO 0 07/05/22 JUL		900	900	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0328298051	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29		350	350	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39		1'000	0	1'000	CHF	105.65%	1'056'500.00	0.06
CH0328298077	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45		900	900	0	CHF	0.00%	0.00	0.00
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44		1'500	0	1'500	CHF	105.95%	1'589'250.00	0.08
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN		900	0	900	CHF	100.60%	905'400.00	0.05
CH0330049856	0.8500 % AFRFIN 0.85 12/27/19		600	0	600	CHF	100.95%	605'700.00	0.03
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24		1'300	0	1'300	CHF	101.20%	1'315'600.00	0.07
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139		800	0	800	CHF	100.12%	800'960.00	0.04
CH0330938827	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31		900	0	900	CHF	108.46%	976'140.00	0.05

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.02.2016	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.07.2016	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38		900	0	900	CHF	101.68%	915'120.00	0.05
CH0330938843	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40		1'000	0	1'000	CHF	131.13%	1'311'300.00	0.07
CH0330938850	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42		700	0	700	CHF	123.04%	861'280.00	0.05
CH0333827472	0.1250 % TEVA 0 1/8 07/27/18		900	0	900	CHF	100.60%	905'364.00	0.05
CH0333827498	0.5000 % TEVA 0 1/2 07/28/22		700	0	700	CHF	101.58%	711'046.00	0.04
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25		900	0	900	CHF	103.00%	927'009.00	0.05
CHF								1'858'057'935.60	98.81

Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht	7'119'187.90	0.38
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'858'057'935.60	98.81
Sonstige Vermögenswerte	15'243'207.68	0.81
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'880'420'331.18	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-6.26	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'880'420'324.92	

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

	Marktrisiko				Kreditrisiko		Währungsrisiko	
	Aktienkurs- änderungsrisiko		Zins- änderungsrisiko					
	CHF	%*	CHF	%*	CHF	%*	CHF	%*
Engagement erhöhende Derivate	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Engagement reduzierende Derivate	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

*¹ in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor)

Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten:	0.00
Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten:	0.00
Höhe des Kontos der zur Wiederanlage zurückbehaltenen Erträge:	0.00
Hinweis auf Soft Commission Agreements:	Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

Klasse	Periode	PVK	max. PVK p.a.	max. PVK Zielfonds p.a.
FA	14.07.2016 - 31.07.2016	0.1800%	0.5000%	0.0000%
NT	01.02.2016 - 31.07.2016	0.0000%	0.0000%	0.0000%
ST	01.02.2016 - 31.07.2016	0.0000%	0.0000%	0.0000%

Gemäss Richtlinie für Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebühren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): 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.

Benchmark

SBI® Total AAA-BBB (TR)

TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der SFAMA - Swiss Funds & Asset Management Association am 16. Mai 2008 herausgegeben wurden, ermittelt.

Erklärung der Fussnoten (fehlende Fussnoten für diesen Bericht nicht relevant)

- 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
- 11) Wert wurde im Vorjahr nicht separat ermittelt und in der Position „Saldo aus dem Anteilverkehr“ der Vermögensrechnung abgebildet

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. Wer-den 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 Konstanzhaltung 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 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des Teilvermögens oder, falls abweichend, 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Referenzwährung 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 Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Klasse 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 Klasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.