

Ungeprüfter Halbjahresbericht **Credit Suisse Institutional Fund (CSIF)** **Umbrella**

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen» für qualifizierte Anleger

31. August 2015

**Inhalts-
verzeichnis**

Verwaltung und Organe	4
Aktien	
CSIF Europe ex CH Index Blue	5
Obligationen	
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	17
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	31
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	53
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	67
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	81

Verwaltung und Organe

Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

Verwaltungsrat

- Dr. Thomas Schmuckli, Präsident
- Luca Diener, Vizepräsident,
Managing Director, Credit Suisse AG, Zürich
- Petra Reinhard Keller (seit 7. April 2015),
Mitglied, Managing Director, Credit Suisse AG,
Zürich
- Jürg Roth, Mitglied,
Managing Director, Credit Suisse AG, Zürich
- Christian Schärer, Mitglied,
Managing Director, Credit Suisse AG, Zürich
- Dr. Christoph Zaborowski (seit 8. Juli 2015),
Mitglied
- Lars Kalbreier (bis 31. März 2015), Mitglied,
Managing Director, Credit Suisse AG, Zürich
- Maurizio Pedrini (bis 31. August 2015), Mitglied,
Managing Director, Credit Suisse AG, Zürich

Geschäftsleitung

- Thomas Schärer, CEO
- Patrick Tschumper, stellvertretender CEO
und Leiter Fund Solutions
- Michael Bünzli, Mitglied, Legal Counsel
- Thomas Federer, Mitglied, Performance & Risk
Management
- Tim Gutzmer, Mitglied, Fund Services
- Hans Christoph Nickl, Mitglied, COO
- Thomas Vonaesch, Mitglied, Real Estate Fund
Management
- Gabriele Wyss, Mitglied, Compliance

Depotbank

Credit Suisse AG, Zürich

Prüfgesellschaft

KPMG AG, Zürich

Informationen über Dritte

Delegation der Anlageentscheide

Die Anlageentscheide sämtlicher Teilvermögen sind an die Credit Suisse AG, Zürich, delegiert.

Delegation weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat verschiedene Teilaufgaben der Fondsadministration an nachfolgende Gruppengesellschaften der Credit Suisse Group AG delegiert:

- Credit Suisse AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Rechts- und Steuerberatung, Finanzwesen der Fondsleitung, Real Estate Portfolio Management und Administration, Facility Management, Personalwesen, Management Information System MIS, Projekt- und Benutzersupport für das Funds Accounting, Risk Management und Investment Guideline Monitoring.

- Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxembourg: Teilaufgaben im Bereich der Fondsbuchhaltung.
- Credit Suisse (Poland) Sp.z.o.o., Polen: Teilaufgaben in den Bereichen Produkt-Masterdaten, Preis-Publikationen, Factsheet-Produktion, KIID-Produktion, dem Erstellen von Reportings sowie um weitere Supportaufgaben im Bereich des Riskmanagements.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung und den genannten Gruppengesellschaften abgeschlossener Vertrag. Es besteht die Möglichkeit, den genannten Gruppengesellschaften weitere Teilaufgaben zu delegieren.

Kurze Übersicht

Kennzahlen		31.08.2015	28.02.2015	28.02.2014
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	1 941.6	2 138.0	1 561.4
Anteilklasse D				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	88.7	190.1	98.6
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 253.36	1 356.70	1 349.70
Anteilklasse F				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	14.1	1.6	8.5
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 135.94	1 229.28	1 222.83
Anteilklasse Z				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	1 838.8	1 946.3	1 454.3
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 334.26	1 444.99	1 437.39

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.08.2015
DAENISCHE KRONE	0.145183
ENGLISCHES PFUND	1.487338
EURO	1.083600
NORWEGISCHE KRONE	0.115327
SCHWEDISCHE KRONE	0.113971
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.967068

**Vermögens-
rechnung per
31. August 2015**

	Konsolidierung	
	31.08.2015	28.02.2015
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
– Sichtguthaben	98 430 887.17	35 417 854.23
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
– Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1 912 186 023.71	2 099 180 882.67
Sonstige Vermögenswerte	6 364 824.32	3 511 084.00
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	2 016 981 735.20	2 138 109 820.90
Andere Verbindlichkeiten	14 045.13	43 443.49
Bankverbindlichkeiten	75 416 065.84	17 197.67
Nettofondsvermögen	1 941 551 624.23	2 138 049 179.74
Anzahl Anteile im Umlauf	1 461 282.927	1 488 386.016

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015	01.03.2014– 28.02.2015
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	2 138 049 179.74	1 561 375 161.94
Ordentliche Jahresausschüttung / Ablieferung VST	–56 197 763.50	–48 798 767.54
Ausgaben von Anteilen	249 633 292.58	790 304 685.31
Rücknahmen von Anteilen	–282 900 935.32	–254 944 162.55
Sonstiges aus Anteilverkehr	–686 762.33	21 476 702.35
Gesamterfolg	–106 345 386.94	68 635 560.23
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 941 551 624.23	2 138 049 179.74
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	1 488 386.016	1 091 754.149
Ausgegebene Anteile	182 432.539	585 657.320
Zurückgenommene Anteile	–209 535.628	–189 025.453
Bestand am Ende der Berichtsperiode	1 461 282.927	1 488 386.016

Inventarwert pro Anteil
Ausserbilanzgeschäfte

	31.08.2015		28.02.2015	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
Engagement erhöhende Derivatpositionen:				
– Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	27 104 983.37	1.40	36 719 623.60	1.72
Total engagement erhöhende Positionen	27 104 983.37	1.40	36 719 623.60	1.72

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
190 114 240.83	98 559 988.65	1 594 379.95	8 516 069.63	1 946 340 558.96	1 454 299 103.66
–4 812 452.97	–5 634 764.04	–55 903.53	–223 551.82	–51 329 407.00	–42 940 451.68
62 160 881.57	228 647 957.32	12 388 641.98	1 570 882.32	175 083 769.03	560 085 845.67
–148 704 492.55	–146 360 058.06	–32 115.95	–7 824 775.17	–134 164 326.82	–100 759 329.32
–5 175 751.46	8 973 280.62	964 204.07	–490 746.03	3 524 785.06	12 994 167.76
–4 909 579.58	5 927 836.34	–780 475.98	46 501.02	–100 655 331.38	62 661 222.87
88 672 845.84	190 114 240.83	14 078 730.54	1 594 379.95	1 838 800 047.85	1 946 340 558.96
140 130.243	73 023.788	1 297.001	6 964.231	1 346 958.772	1 011 766.130
47 158.886	178 252.722	11 124.053	1 314.255	124 149.600	406 090.343
–116 541.001	–111 146.267	–27.170	–6 981.485	–92 967.457	–70 897.701
70 748.128	140 130.243	12 393.884	1 297.001	1 378 140.915	1 346 958.772
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
1 253.36	1 356.70	1 135.94	1 229.28	1 334.26	1 444.99

**Erfolgsrechnung
für die Zeit vom
1. März 2015 bis
zum 31. August
2015**

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	15 154.32	38 539.82
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
– Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien	42 988 169.66	48 410 937.72
– Ausgleichszahlungen	23 357.84	0.00
Sonstige Erträge	731 429.67	76 905.26
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	2 898 243.32	11 699 069.40
Total Erträge abzüglich	46 656 354.81	60 225 452.20
Passivzinsen	352.25	5 000.91
Negativzinsen	1 593.77	0.00
Reglementarische Vergütung an:		
– die Fondsleitung	80 808.98	191 843.85
Sonstige Aufwendungen	112 406.11	58 994.14
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	4 330 286.62	4 421 486.01
Nettoertrag	42 130 907.08	55 548 127.29
Realisierte Kapitalgewinne	52 814 273.19	51 763 884.92
Realisierte Kapitalverluste	–33 366 913.26	–21 647 923.98
Realisierter Erfolg	61 578 267.01	85 664 088.23
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	–167 923 653.95	–17 028 528.00
Gesamterfolg	–106 345 386.94	68 635 560.23

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
1 254.03	4 516.60	19.30	174.89	13 880.99	33 848.33
3 594 750.66	5 731 424.33	47 845.74	217 264.79	39 345 573.26	42 462 248.60
2 030.39	0.00	24.65	0.00	21 302.80	0.00
57 030.51	9 739.78	802.12	0.00	673 597.04	67 165.48
806 662.37	2 124 910.58	249 973.57	31 590.91	1 841 607.38	9 542 567.91
4 461 727.96	7 870 591.29	298 665.38	249 030.59	41 895 961.47	52 105 830.32
27.33	464.63	0.40	20.79	324.52	4 515.49
126.83	0.00	11.08	0.00	1 455.86	0.00
78 861.84	179 606.39	1 947.14	12 237.46	0.00	0.00
8 711.63	6 474.40	119.55	151.80	103 574.93	52 367.94
2 498 732.28	2 889 823.97	318.32	199 641.71	1 831 236.02	1 332 020.33
1 875 268.05	4 794 221.90	296 268.89	36 978.83	39 959 370.14	50 716 926.56
4 650 795.55	5 918 893.76	257 976.59	218 845.86	47 905 501.05	45 626 145.30
–3 762 241.60	–3 244 543.37	–116 879.24	–196 414.95	–29 487 792.42	–18 206 965.66
2 763 822.00	7 468 572.29	437 366.24	59 409.74	58 377 078.77	78 136 106.20
–7 673 401.58	–1 540 735.95	–1 217 842.22	–12 908.72	–159 032 410.15	–15 474 883.33
–4 909 579.58	5 927 836.34	–780 475.98	46 501.02	–100 655 331.38	62 661 222.87

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						
Beteiligungspapiere						
Australien						
SOUTH32		618 733	618 733			
					0.00	0.00
Belgien						
AGEAS 2049-12	65 287	1 387	9 718	56 956	2 252 689.54	0.11
ANHEUSER BUSCH INBEV	236 183	15 165	21 625	229 723	24 260 507.56	1.20
COLRUYT	20 568	1 149	2 054	19 663	926 953.51	0.05
DELHAIZE GROUP 2049-12	30 447	1 077	1 785	29 739	2 575 114.17	0.13
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	23 669	1 047	2 163	22 553	1 692 361.33	0.08
KBC GROUP	74 236	3 505	5 991	71 750	4 600 366.91	0.23
PROXIMUS	44 480	2 273	3 001	43 752	1 521 613.27	0.08
SOLVAY	17 639	910	1 504	17 045	1 937 499.01	0.10
TELENET GROUP HOLDING 2021-12	15 115	1 119	1 761	14 473	787 911.05	0.04
UCB	37 490	1 271	2 411	36 350	2 660 323.60	0.13
UMICORE	27 377	6 245	6 769	26 853	1 037 486.02	0.05
					44 252 825.97	2.19
Bermudas						
SEADRILL	115 977	6 098	23 430	98 645	705 338.15	0.03
					705 338.15	0.03
Deutschland						
ADIDAS (reg. shares)	59 617	6 824	6 635	59 806	4 323 841.75	0.21
ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted)	134 849	8 475	12 786	130 538	20 121 401.45	1.00
AXEL SPRINGER (reg. shares)	11 232	2 305		13 537	791 669.37	0.04
BASF (reg. shares)	269 556	17 563	24 745	262 374	20 419 034.06	1.01
BAYER (reg. shares)	243 085	16 965	23 857	236 193	30 955 789.97	1.53
BEIERSDORF	29 472	4 345	5 483	28 334	2 265 246.86	0.11
BMW	97 845	7 215	10 214	94 846	8 450 170.83	0.42
BMW (pref. shares)	16 024	704	1 355	15 373	1 081 282.65	0.05
BRENNTAG (reg. shares)	45 904	1 478	3 237	44 145	2 371 685.18	0.12
CELESIO	15 201		15 201			
COMMERZBANK	286 353	40 251	23 886	302 718	3 277 628.05	0.16
CONTINENTAL	32 520	1 463	2 499	31 484	6 463 288.02	0.32
DAIMLER (reg. shares)	282 622	17 815	25 219	275 218	21 370 891.27	1.06
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN (rights) 30.06.2015		103 828	103 828			
DEUTSCHE BANK (reg. shares)	407 728	28 871	42 317	394 282	11 225 835.45	0.56
DEUTSCHE BOERSE (reg. shares) 2049-12	57 203	2 705	4 671	55 237	4 775 815.55	0.24
DEUTSCHE LUFTHANSA (reg. shares) 2014-03	68 040	3 554	7 887	63 707	749 352.19	0.04
DEUTSCHE POST (reg. shares)	286 138	13 100	22 304	276 934	7 368 603.93	0.37
DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares)	937 906	61 167	92 269	906 804	14 979 932.36	0.74
DEUTSCHE WOHNEN (reg. shares) 2049-12	83 637	25 915	13 306	96 246	2 444 608.36	0.12
DEUTSCHE WOHNEN (rights) 03.06.2015		85 801	85 801			
E.ON (reg. shares)	591 516	34 421	54 196	571 741	6 260 437.03	0.31
EVONIK INDUSTRIES (reg. shares) 2049-01		40 016		40 016	1 439 813.22	0.07
FRAPORT	10 741	1 934		12 675	740 021.86	0.04
FRESENIUS	111 860	5 478	8 943	108 395	7 405 652.63	0.37
FRESENIUS MEDICAL CARE	64 154	3 995	5 892	62 257	4 601 561.55	0.23
FUCHS PETROLUB SE (pref. shares)	20 115	1 340	2 287	19 168	798 623.60	0.04
GEA GROUP 2014-03	54 296	1 783	3 482	52 597	1 983 395.00	0.10
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG (reg. shares)	17 707	800	1 198	17 309	1 699 671.66	0.08
HEIDELBERGCEMENT 2022-01	41 785	1 464	2 545	40 704	2 971 037.71	0.15
HENKEL	34 229	2 474	7 515	29 188	2 587 812.52	0.13
HENKEL (pref. shares)	52 873	2 257	3 884	51 246	5 180 964.45	0.26
HUGO BOSS (reg. shares)	17 081	3 435	1 357	19 159	2 115 514.56	0.10
INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares)	333 942	16 568	32 028	318 482	3 366 174.61	0.17
K & S	50 303	8 403	3 976	54 730	1 976 946.44	0.10
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	6 577	165	727	6 015	787 682.66	0.04
LANXESS 2025-08	26 833	1 235	1 910	26 158	1 284 019.84	0.06
LINDE	54 911	3 015	4 864	53 062	8 906 437.60	0.44
MAN 2049-12	10 382	433	943	9 872	1 000 197.48	0.05
MERCK	38 232	1 925	3 452	36 705	3 391 489.59	0.17
METRO	47 329	2 361		49 690	1 401 561.51	0.07
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT (reg. s	51 109	2 833	6 238	47 704	8 467 158.51	0.42
OSRAM LICHT (reg. shares)	26 479	911	1 867	25 523	1 304 291.05	0.06
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING (pref. shares) 2049-12	45 339	2 214	4 411	43 142	2 903 559.97	0.14
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA	64 800	2 337	3 757	63 380	2 980 993.24	0.15
RWE -A-	144 825	7 507	10 206	142 126	2 062 933.59	0.10
SAP SE	272 182	34 361	25 968	280 575	18 238 823.89	0.90
SIEMENS (reg. shares)	232 686	15 247	21 396	226 537	21 714 762.13	1.08
SYMRISE	36 016	3 604	4 334	35 286	2 056 709.58	0.10
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING (reg. shares) 2023-	176 820	3 925	16 474	164 271	965 315.99	0.05
THYSEN KRUPP	133 949	7 028	34 184	106 793	2 236 306.30	0.11
TUI (reg. shares)	135 158	26 154	18 492	142 820	2 476 156.03	0.12
UNITED INTERNET (reg. shares)	35 863	1 873	2 506	35 230	1 654 705.26	0.08
VONOVIA (reg. shares)	102 007	40 285	8 430	133 862	4 233 367.81	0.21
VW	8 766	2 324	823	10 267	1 854 591.04	0.09
VW (pref. shares)	47 981	2 990	4 596	46 375	8 517 705.53	0.42
					305 002 472.74	15.12
Dänemark						
A.P. MOELLER - MAERSK -A-	1 133	76	92	1 117	1 801 698.24	0.09
A.P. MOELLER - MAERSK -B-	2 117	74	165	2 026	3 332 607.54	0.17
CARLSBERG -B- 2014-04	31 738	1 646	2 441	30 943	2 255 178.67	0.11
COLOPLAST -B- 2049-12	32 926	1 806	2 978	31 754	2 088 850.34	0.10
DANSKE BANK	194 170	24 289	16 710	201 749	6 033 835.04	0.30
DE SAMMENSLUTTEDE VOGNMAEND 2014-04	51 651	8 683	10 471	49 863	1 720 044.42	0.09
ISS	36 408	9 057	2 844	42 621	1 434 958.05	0.07
NOVO-NORDISK -B-	589 192	41 573	71 258	559 507	29 990 384.81	1.49
NOVOZYMES -B-	70 938	3 653	7 892	66 699	2 806 289.85	0.14
PANDORA 2024-01	33 561	5 036	7 158	31 439	3 507 740.18	0.17

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
TDC	237 268	27 151	31 213	233 206	1 425 061.04	0.07
TRYG A/S		36 197		36 197	686 851.71	0.03
TRYG A/S	6 144		6 144			
VESTAS WIND SYSTEMS 2049-12	66 908	2 412	4 981	63 739	3 289 725.58	0.16
WILLIAM DEMANT HOLDING 2020-08	6 908	4 391	3 942	7 357	577 312.92	0.03
					60 950 538.39	3.02
Finnland						
ELISA -A-	42 576	931	2 961	40 546	1 304 888.67	0.06
FORTUM 2014-06	129 889	6 128	8 713	127 304	2 001 605.37	0.10
KONE -B-	92 788	4 559	1 267	96 080	3 673 081.52	0.18
METSO	32 527	2 215	3 914	30 828	734 914.86	0.04
NESTE OYJ	36 698	4 445	3 860	37 283	924 348.77	0.05
NOKIA	1 107 128	80 445	136 356	1 051 217	6 356 170.98	0.32
NOKIAN TYRES	33 545	1 408	3 584	31 369	818 853.99	0.04
ORION CORPORATION (new) -B-	28 627	5 796	5 895	28 528	1 093 699.85	0.05
SAMPO -A-	132 412	9 018	13 801	127 629	5 950 996.69	0.30
STORA ENSO -R-	160 986	7 524	10 962	157 548	1 354 655.37	0.07
UPM-KYMMENE	157 892	5 670	10 583	152 979	2 464 970.82	0.12
WAERTSILAE -B- 2049-12	43 255	4 498	5 087	42 666	1 706 917.84	0.08
					28 385 104.73	1.41
Frankreich						
ACCOR	51 010	13 333	5 436	58 907	2 698 801.11	0.13
AEROPORTS DE PARIS	8 791	391	857	8 325	923 296.28	0.05
ALCATEL-LUCENT	832 724	30 586	44 613	818 697	2 656 097.37	0.13
ALSTOM 2014-03	63 155	6 928	7 742	62 341	1 869 183.42	0.09
ARKEMA FRANCE 2024-10	19 146	948	1 395	18 699	1 274 697.29	0.06
ATOS	23 573	2 862	1 661	24 774	1 818 219.06	0.09
AXA	529 636	74 953	43 752	560 837	13 658 573.83	0.68
BNP PARIBAS -A-	310 131	20 063	27 530	302 664	18 454 686.79	0.91
BOLLORE	160 244	105 513	18 897	246 860	1 288 802.94	0.06
BOUYGUES	49 012	12 810	4 543	57 279	2 106 571.78	0.10
BUREAU VERITAS REGISTRE INTERNATIONAL DE CLASSIFIC	64 778	16 508	7 055	74 231	1 637 289.27	0.08
CAP GEMINI	42 413	5 262	3 254	44 421	3 856 543.80	0.19
CARREFOUR	184 757	7 653	34 631	157 779	4 954 691.02	0.25
CASINO GUICHARD PERRACHON	16 523	850	1 535	15 838	967 940.00	0.05
CHRISTIAN DIOR	16 145	582	1 389	15 338	2 748 990.47	0.14
CNP ASSURANCES 2014-03	51 605	1 358	6 332	46 631	694 778.58	0.03
CREDIT AGRICOLE 2049-12	305 187	14 562	25 081	294 668	3 858 767.63	0.19
DANONE	171 252	15 186	20 826	165 612	9 940 132.27	0.49
DASSAULT SYSTEMES	37 884	1 343	2 381	36 846	2 471 040.29	0.12
EDENRED	60 248	4 707	7 502	57 453	1 176 951.02	0.06
EDF 2014-03	70 649	3 537	4 901	69 285	1 448 239.69	0.07
ENGIE	428 066	23 074	33 475	417 665	7 234 519.98	0.36
ESSILOR INTERNATIONAL	60 445	2 919	4 758	58 606	6 756 981.11	0.34
EURAZEO	11 407	912	1 537	10 782	676 467.42	0.03
EUTELSAT COMMUNICATIONS 2049-12	45 110	7 089	3 244	48 955	1 425 655.28	0.07
FONCIERE DES REGIONS		529	529			
FONCIERE DES REGIONS (rights) 12.03.2015		8 476	8 476			
FONCIERE DES REGIONS 2025-05	8 476	2 810	2 218	9 068	730 765.93	0.04
GEICINA	8 470	2 120	773	9 817	1 195 677.61	0.06
GRUPE EURO TUNNEL (regroupement) 2024-03	136 482	14 509	18 648	132 343	1 730 203.95	0.09
HERMES INTERNATIONAL	7 811	287	552	7 546	2 589 198.16	0.13
ICADE 2049-12	11 065	705	2 825	8 945	618 885.41	0.03
ILIAD	7 634	435	532	7 537	1 644 035.86	0.08
IMERYS	9 887	701		10 588	705 254.95	0.03
INGENICO		15 756		15 756	1 884 881.46	0.09
JC DECAUX		24 219	24 219			
JC DECAUX 2014-03	19 558	28 880	28 439	19 999	694 119.45	0.03
KERING 2014-03	22 402	1 468	2 297	21 573	3 570 760.80	0.18
KLEPIERRE	51 372	5 156	2 487	54 041	2 296 677.22	0.11
L'AIR LIQUIDE	100 560	7 028	9 267	98 321	11 383 866.91	0.56
L'OREAL	74 282	4 752	7 047	71 987	11 911 380.79	0.59
LAFARGE	55 340	58 458	113 798			
LAFARGE		57 338	57 338			
LAGARDERE (reg. shares) 2024-06	35 329	841	3 604	32 566	855 746.55	0.04
LEGRAND	78 506	4 689	7 047	76 148	4 243 693.62	0.21
LVMH	82 512	5 431	8 142	79 801	12 854 116.85	0.64
MICHELIN (reg. shares)	53 394	4 744	4 739	53 399	4 993 011.77	0.25
NATIXIS	273 278	28 625	32 800	269 103	1 650 456.06	0.08
NUMERICABLE SFR	28 520	1 366	2 027	27 859	1 383 969.43	0.07
ORANGE 2049-12	547 952	44 657	24 693	567 916	8 670 898.33	0.43
PERNOD-RICARD	62 807	2 763	4 839	60 731	6 154 374.60	0.31
PEUGEOT	114 188	18 518	8 632	124 074	2 070 477.43	0.10
PUBLICIS GROUPE	55 183	6 364	7 576	53 971	3 714 838.61	0.18
REMY COINTREAU	7 225	309		7 534	431 540.71	0.02
RENAULT	56 881	2 621	4 449	55 053	4 419 870.87	0.22
REXEL	81 702	8 322	6 486	83 538	1 237 885.30	0.06
SAFRAN	80 260	9 285	6 053	83 492	6 298 655.85	0.31
SANOFI	351 340	22 257	37 390	336 207	32 121 557.02	1.59
SCHNEIDER ELECTRIC	155 313	18 788	15 242	158 859	9 696 624.37	0.48
SCOR REGPT	45 246	4 586	5 053	44 779	1 525 548.17	0.08
SOCIETE BIC	8 418	397	616	8 199	1 256 703.53	0.06
SOCIETE GENERALE PARIS -A-	214 320	14 371	21 223	207 468	9 769 219.57	0.48
SODEXO	27 830	1 083	2 143	26 770	2 275 095.24	0.11
ST GOBAIN 2024-12	130 753	19 311	13 373	136 691	6 067 668.93	0.30
SUEZ ENVIRONNEMENT	86 879	4 263	5 857	85 285	1 486 492.48	0.07
TECHNIP	29 964	2 967	3 531	29 400	1 547 016.71	0.08
THALES	27 247	5 899	2 500	30 646	2 039 303.62	0.10
TOTAL	629 143	46 690	59 278	616 555	27 261 779.62	1.35
UNIBAIL RODAMCO 2024-05	28 995	2 454	3 313	28 136	7 050 389.22	0.35
VALEO 2020-12	22 381	1 992	2 015	22 358	2 713 438.43	0.13
VALLOUREC 2049-12	31 406	3 182	34 588			

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
VEOLIA ENVIRONNEMENT 2049-12	125 244	12 757	8 489	129 512	2 743 631.42	0.14
VINCI	140 151	6 131	9 645	136 637	8 500 116.17	0.42
VIVENDI	358 731	16 584	44 252	331 063	7 908 420.37	0.39
WENDEL	9 378	359	1 664	8 073	1 000 322.69	0.05
ZODIAC AEROSPACE	54 343	7 539	3 917	57 965	1 702 488.75	0.08
					323 198 978.49	16.02
Guernsey						
FRIENDS LIGE GROUP	419 758		419 758			
					0.00	0.00
Irland						
BANK OF IRELAND	8 034 124	694 063	983 694	7 744 493	2 979 136.08	0.15
CRH 2049-12	240 873	11 150	16 834	235 189	6 801 967.86	0.34
KERRY GROUP -A-	46 929	5 986	7 809	45 106	3 242 979.77	0.16
RYANAIR HOLDINGS	54 545		7 084	47 461	632 059.21	0.03
					13 656 142.92	0.68
Italien						
ASSICURAZIONI GENERALI 2049-12	345 440	15 764	27 599	333 605	5 903 203.19	0.29
ATLANTIA	122 460	5 839	9 834	118 465	3 062 876.56	0.15
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA	1 264 288		1 264 288			
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA		776 906	51 911	724 995	1 471 437.39	0.07
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	106 159	4 937	7 342	103 754	1 722 394.42	0.09
ENEL	1 946 562	233 069	166 730	2 012 901	8 759 616.97	0.43
ENEL GREEN POWER	524 595	12 011	51 116	485 490	894 330.84	0.04
ENI	752 028	52 693	76 682	728 039	11 541 651.77	0.57
EXOR	29 003	1 219	2 107	28 115	1 248 168.01	0.06
FINMECCANICA	118 712	5 394	8 190	115 916	1 516 071.39	0.08
INTESA SANPAOLO	3 750 249	262 793	387 738	3 625 304	12 782 946.62	0.63
INTESA SANPAOLO (risp)	267 185	21 090	29 878	258 397	824 317.03	0.04
LUXOTTICA 2049-12	49 782	1 965	3 688	48 059	3 145 434.64	0.16
MEDIOBANCA 2049-12	176 241	11 023	25 692	161 572	1 566 960.80	0.08
MONTE PASCHI SIENA AZ POST (rights) 12.06.2015		63 214	63 214			
PIRELLI & C.	70 945	9 414	5 884	74 475	1 205 674.58	0.06
PRYSMIAN	60 868	3 924	9 518	55 274	1 142 195.87	0.06
SAIPEM 2014-03	77 673	4 232	10 941	70 964	660 157.23	0.03
SNAM	602 317	70 010	75 429	596 898	2 821 335.82	0.14
TELECOM ITALIA	2 998 172	224 149	337 671	2 884 650	3 385 248.70	0.17
TELECOM ITALIA (sav. shares)	1 767 303	115 160	159 421	1 723 042	1 668 243.41	0.08
TERNA	441 566	42 075	41 624	442 017	1 990 597.74	0.10
UNICREDIT	1 300 538	210 230	143 604	1 367 164	8 636 905.45	0.43
UNIONE DI BANCHE ITALIANE 2049-12	250 266	26 360	18 227	258 399	1 948 808.05	0.10
UNIPOLSAI	265 278	98 632	41 428	322 482	713 559.53	0.04
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI (rights) -A- 15.05.2015		265 278	265 278			
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI -B- (rights) 15.05.2015		265 278	265 278			
					78 612 136.01	3.90
Jersey						
EXPERIAN 2049-12	293 133	13 420	24 009	282 544	4 660 444.17	0.23
GLENCORE	3 097 908	379 526	296 943	3 180 491	7 015 279.77	0.35
PETROFAC 2049-12	75 896	3 751	7 523	72 124	956 873.07	0.05
RANDGOLD RESOURCES 2049-12	25 861	2 579	2 229	26 211	1 543 400.96	0.08
SHIRE	174 171	14 297	19 439	169 029	12 633 013.55	0.63
WOLSELEY 2024-06	76 055	8 467	10 029	74 493	4 661 199.06	0.23
WPP 2012	389 352	30 778	47 813	372 317	7 481 314.11	0.37
					38 951 524.69	1.93
Luxemburg						
ALTICE (reg. shares)	25 292	1 337	26 629			
ARCELORMITTAL (new) (reg. shares) 2049-12	295 986	10 519	20 443	286 062	2 150 928.90	0.11
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SDR	19 421	848	1 502	18 767	1 208 472.66	0.06
RTL GROUP 2023-04	11 495	249	1 135	10 609	892 427.68	0.04
SES	90 043	8 344	6 049	92 338	2 649 021.17	0.13
SUBSEA 7 2049-12	84 861	7 704	10 723	81 842	664 476.31	0.03
TENARIS	140 994	15 584	15 821	140 757	1 766 231.22	0.09
					9 331 557.94	0.46
Niederlande						
AEGON	539 833	37 682	68 619	508 896	3 025 198.23	0.15
AIRBUS GROUP NV	173 863	12 812	17 912	168 763	10 623 010.48	0.53
AKZO NOBEL	71 827	8 068	9 683	70 212	4 590 771.18	0.23
ALTICE -A-		79 887	79 887		2 200 929.20	0.11
ALTICE -B-		26 629	26 629		807 368.06	0.04
ASML HOLDING	103 335	6 868	11 150	99 053	8 767 027.30	0.43
CNH Industrial N.V. (reg. shares)	276 668	26 585	30 729	272 524	2 078 961.33	0.10
DELTA LLOYD	58 960	8 653	9 212	58 401	599 103.23	0.03
FIAT INVESTMENTS CHRYSLER -A-	265 993	13 371	23 154	256 210	3 481 469.62	0.17
GEMALTO	23 113	2 652	2 842	22 923	1 594 687.09	0.08
HEINEKEN	68 109	4 708	7 026	65 791	5 026 024.50	0.25
HEINEKEN HOLDING	29 549	1 370	2 048	28 871	1 945 903.09	0.10
ING GROEP (cert. shares)	1 139 996	73 938	109 121	1 104 813	16 335 457.89	0.81
KONINKLIJKE AHOLD	264 476	18 198	26 785	255 889	4 884 310.46	0.24
KONINKLIJKE BOSKALIS WESTMINSTER 2014-03	25 405	910	1 897	24 418	1 228 507.38	0.06
KONINKLIJKE DSM 2025-04	51 112	6 053	4 763	52 402	2 663 681.49	0.13
KONINKLIJKE KPN	947 114	35 609	70 169	912 554	3 433 264.68	0.17
KONINKLIJKE VOPAK 2025-04	20 927	589	2 390	19 126	761 019.56	0.04
NN GROUP	47 718	13 323	5 685	55 356	1 633 057.91	0.08
OCI (reg. shares)	25 056	25 855	25 056	25 855	736 273.04	0.04
QIAGEN (reg. shares)	68 065	4 037	8 898	63 204	1 613 916.29	0.08
RANDSTAD HOLDING	36 854	4 870	5 507	36 217	2 211 441.17	0.11
RELX	206 962	163 307	26 657	343 612	5 114 061.92	0.25
ROYAL PHILIPS	276 312	28 010	37 023	267 299	6 638 667.90	0.33
STMICROELECTRONICS 2014-03	186 086	9 413	13 540	181 959	1 276 286.41	0.06
TNT EXPRESS	128 154	23 335	11 693	139 796	1 141 575.48	0.06
UNILEVER (cert. shares)	478 198	37 026	52 793	462 431	17 906 459.43	0.89
WOLTERS KLUWER 2025-04	89 530	9 553	12 189	86 894	2 659 973.06	0.13
					114 978 407.38	5.70

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Norwegen						
DNB ASA 2014-03	289 330	13 378	22 731	279 977	3 823 003.26	0.19
GUJENSIDIGE FORSIKRING ASA	59 647	1 425	6 696	54 376	770 707.79	0.04
NORSK HYDRO 2014-03	393 254	18 715	29 055	382 914	1 265 633.73	0.06
ORKLA 2049-12	238 518	27 689	25 275	240 932	1 694 942.35	0.08
STATOIL ASA	330 108	14 776	24 624	320 260	4 576 195.99	0.23
TELENOR 2014-03	222 006	15 628	23 419	214 215	4 078 754.46	0.20
YARA INTERNATIONAL	53 233	2 884	4 705	51 412	2 189 648.57	0.11
					18 398 886.15	0.91
Oesterreich						
ANDRITZ	21 397	2 703	2 003	22 097	1 022 900.89	0.05
ERSTE GROUP BANK 2049-12	81 504	8 154	9 489	80 169	2 306 862.82	0.11
IMMOFINANZ IMMOBILIEN ANLAGEN 2049-12	281 647		281 647			
OMV	43 496	1 645	3 899	41 242	1 020 715.74	0.05
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL 2049-12	35 243			35 243	460 945.03	0.02
VOESTALPINE	33 015	1 367	2 628	31 754	1 121 721.48	0.06
WIENER STAEDTISCHE VERSICHERUNG AG VIENNA INSURANC	11 236		11 236			
					5 933 145.96	0.29
Portugal						
BANCO COMERCIAL PORTUGUES (reg. shares)	10 062 064	1 658 452	1 375 325	10 345 191	706 233.08	0.04
BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares) 2014-04	655 819			655 819	7.11	0.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares) 2014-04	678 846	30 515	51 643	657 718	2 227 910.28	0.11
GALP ENERGIA -B- 2049-08	115 473	2 440	9 433	108 480	1 104 607.28	0.05
JERONIMO MARTINS	72 874	4 949	6 906	70 917	949 043.92	0.05
					4 987 801.67	0.25
Schweden						
ALFA LAVAL 2014-03	91 903	11 826	16 923	86 806	1 412 770.05	0.07
ASSA ABLOY -B-	98 891	1 922	100 813			
ASSA ABLOY -B-		319 127	32 310	286 817	5 298 847.62	0.26
ATLAS COPCO -A-		209 680	18 071	191 609	4 662 376.17	0.23
ATLAS COPCO -A- 2014-03	198 304	6 976	205 280			
ATLAS COPCO -A- redemption shares 16.06.2015		198 020	198 020			
ATLAS COPCO -B-		119 680	7 448	112 232	2 471 253.80	0.12
ATLAS COPCO -B-	115 689		115 689			
ATLAS COPCO -B- redemption shares 16.06.2015		113 746	113 746			
BOLIDEN 2014-03	80 653	3 195	5 878	77 970	1 243 193.63	0.06
ELECTROLUX -B- 2049-12	70 062	7 352	8 516	68 898	1 877 499.02	0.09
ELEKTA (fria) -B-	108 535	3 561	112 096			
GETINGE INDUSTRIER (fria) -B-	58 480	2 865	4 358	56 987	1 222 331.32	0.06
HAKON INVEST AB	22 180	1 779	2 682	21 277	762 648.76	0.04
HENNES & MAURITZ STOCKHOLM -B- 2021-01	280 336	21 918	30 843	271 411	10 077 946.57	0.50
HEXAGON 2014-03	75 613	2 990	5 107	73 496	2 285 080.98	0.11
HUSQVARNA -B- 2021-10	118 725	8 543	14 950	112 318	704 053.36	0.03
INDUSTRIVAERDEN -C-	48 791	1 193	5 483	44 501	782 073.68	0.04
INVESTOR -B-	130 416	9 340	9 172	130 584	4 537 753.69	0.22
KINNEVIK INVESTMENT AB -B-	68 688	6 864	7 821	67 731	1 847 241.65	0.09
LUNDIN PETROLEUM	65 637	11 594	17 958	59 273	747 146.15	0.04
NORDEA BANK	897 821	65 565	94 904	868 482	9 917 953.55	0.49
SANDVIK 2024-12	316 173	24 665	32 658	308 180	2 873 103.57	0.14
SECURITAS -B-	93 724	2 196	7 659	88 261	1 086 390.92	0.05
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	449 625	20 781	35 432	434 974	4 885 549.90	0.24
SKANSKA -B-	113 046	3 394	9 756	106 684	2 018 370.57	0.10
SVENSKA CELLULOSEA -B- 2049-12	173 966	8 836	14 386	168 416	4 633 553.06	0.23
SVENSKA HANDELSBANKEN -A-	147 644	1 730	149 374			
SVENSKA HANDELSBANKEN -A-		466 837	38 344	428 493	6 177 713.79	0.31
SVENSKA KULLAGERFABRIKEN -B- 2014-03	117 584	4 074	8 567	113 091	2 086 740.38	0.10
SWEDBANK -A- 2049-12	267 882	16 557	25 098	259 341	5 716 381.14	0.28
SWEDISH MATCH	58 520	6 662	8 599	56 583	1 614 136.83	0.08
TELE2 -B- 2049-12	94 990	3 816	9 940	88 866	847 217.86	0.04
TELEFON LM ERICSSON -B- 2014-03	899 228	82 898	112 708	869 418	8 179 734.95	0.41
TELIAONERA 2014-03	767 035	56 584	79 264	744 355	4 053 402.98	0.20
VOLVO (fria) -B- 2014-03	454 053	20 718	35 130	439 641	4 614 783.63	0.23
					98 637 249.58	4.89
Schweiz						
COCA-COLA HBC (reg. shares)	59 555	2 081	4 831	56 805	1 129 607.70	0.06
					1 129 607.70	0.06
Spanien						
CAIXABANK E. 2015		6 792	6 792			
ABERTIS (rights) 29.06.2015		134 538	134 538			
ABERTIS E. 2015		6 726	6 726			
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS 2049-12	120 390	34 072	19 517	134 945	2 158 301.69	0.11
ACS (rights) 16.07.2015		57 004	57 004			
ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS 2049-12	51 969	8 614	6 124	54 459	1 707 505.64	0.08
AENA	17 925	3 373	2 032	19 266	2 139 855.35	0.11
AMADEUS IT HOLDING -A-	132 238	6 306	10 699	127 845	5 168 660.34	0.26
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA (reg. shares)	1 839 281	142 389	180 125	1 801 545	16 130 649.85	0.80
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA E. 2015		26 591	26 591			
BANCO DE SABADELL (reg. shares)	1 012 842	527 896	151 995	1 388 743	2 859 199.64	0.14
BANCO DE SABADELL (rights) 17.06.2015		1 456 475	1 456 475			
BANCO POPULAR ESPANOL	523 868	33 158	70 750	486 276	2 013 394.47	0.10
BANCO POPULAR ESPANOL (rights) 30.04.2015		523 868	523 868			
BANCO POPULAR ESPANOL E. 2015		1 991	1 991			
BANCO SABADELL E. 2015		276 228	276 228			
BANCO SABADELL E. 2015		24 686	24 686			
BANCO SABADELL (rights) 17.04.2015		1 012 842	1 012 842			
BANCO SANTANDER (reg. shares)	4 136 014	351 325	396 781	4 090 558	24 201 606.42	1.20
BANCO SANTANDER (rights) 28.04.2015		4 181 930	4 181 930			
BANCO SANTANDER i 15		90 911	90 911			
BANKIA	1 345 031	67 941	88 562	1 324 410	1 545 635.74	0.08
BANKINTER (reg. shares)	197 544	9 204	13 108	193 640	1 410 046.20	0.07
BBVA (rights) 14.04.2015		1 861 463	1 861 463			
CAIXABANK	679 273	152 197	78 848	752 622	3 147 989.03	0.16

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
CAIXABANK (rights) 17.03.2015		679 273	679 273			
DSTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION 2045-02	184 185	5 784	16 385	173 584	1 009 321.11	0.05
ENAGAS	59 376	6 502	4 259	61 619	1 630 531.91	0.08
ENDESA 2049-12	94 240	5 990	9 655	90 575	1 815 720.80	0.09
FERROVIAL	115 902	25 480	13 924	127 458	2 944 579.58	0.15
FERROVIAL E. 2015		1 846	1 846			
FERROVIAL rts 18.11.2014		121 837	121 837			
GAS NATURAL 2049-08	102 514	9 574	11 968	100 120	1 963 669.58	0.10
GRIFOLS -A-	43 498	2 275	3 395	42 378	1 678 634.87	0.08
IBERDROLA	1 525 538	183 585	167 599	1 541 524	10 114 244.19	0.50
IBERDROLA (rights) 17.07.2015		1 639 869	1 639 869			
IBERDROLA E. 2015		30 367	30 367			
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL INDITEX	322 285	21 353	32 038	311 600	10 041 703.86	0.50
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	242 936	7 622	16 586	233 972	1 886 024.99	0.09
MAPFRE (reg. shares) 2049-12	279 506	69 242	47 971	300 777	857 174.75	0.04
RED ELECTRICA DE ESPANA	32 151	1 694	3 410	30 435	2 349 450.03	0.12
REPSOL	308 815	33 976	37 205	305 586	4 223 601.28	0.21
REPSOL (rights) 03.07.2015		305 831	305 831			
REPSOL E. 2015		8 995	8 995			
TELEFONICA	1 244 695	161 099	136 188	1 269 606	17 320 630.33	0.86
TELEFONICA (rights) 12.04.2015		1 259 296	1 259 296			
TELEFONICA E. 2015		78 705	78 705			
ZARDOYA OTIS (rights) 30.06.2015 2049-12		52 965	52 965			
ZARDOYA OTIS 2049-12	52 965	1 966		54 931	567 256.40	0.03
ZARDOYA OTIS E. 2015		2 118		2 118	21 871.97	
					120 907 260.02	5.99
Vereinigtes Königreich						
3i GROUP	283 464	41 102	44 393	280 173	2 049 389.36	0.10
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT	268 094	55 388	55 498	267 984	1 271 080.51	0.06
ADMIRAL GROUP	56 787	7 394	4 164	60 017	1 383 616.25	0.07
AGGREKO 2024-10	74 698	8 296	10 567	72 427	1 149 408.99	0.06
AMEC 2049-12	113 469	7 946	13 007	108 408	1 300 395.26	0.06
ANGLO AMERICAN 2049-12	412 778	19 481	33 425	398 834	4 395 619.14	0.22
ANTOFAGASTA 2014-03	117 288	4 149	10 500	110 937	1 004 854.97	0.05
ARM HOLDINGS 2014-03	415 146	21 408	32 823	403 731	5 605 522.42	0.28
ASHTAD GROUP	149 038	5 317	10 070	144 285	2 029 048.33	0.10
ASSOCIATED BRITISH FOODS 2049-12	105 259	5 321	8 786	101 794	4 847 894.74	0.24
ASTRAZENECA	372 940	22 350	34 360	360 930	22 117 186.06	1.10
AVIVA 2014-03	870 945	364 296	78 959	1 156 282	8 320 306.08	0.41
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP	74 800	2 638	6 738	70 700	1 018 949.98	0.05
BAE SYSTEMS	932 937	68 449	95 648	905 738	6 091 760.51	0.30
BARCLAYS	4 851 698	293 836	359 497	4 786 037	18 611 199.82	0.92
BARRATT DEVELOPMENTS 2023-08		304 252	15 890	288 362	2 742 762.81	0.14
BG GROUP 2014-03	1 007 800	68 638	100 411	976 027	14 438 429.63	0.72
BHP BILLITON 2049-12	624 030	50 179	70 490	603 719	10 164 615.26	0.50
BP	5 376 135	319 746	475 246	5 220 635	27 992 280.00	1.39
BRITISH AMERICAN TOBACCO	547 466	36 338	51 364	532 440	27 550 835.73	1.37
BRITISH LAND 2025-05	285 611	18 546	28 946	275 211	3 356 520.58	0.17
BRITISH SKY BROADCASTING GROUP 2024-06	305 004	15 131	25 172	294 963	4 575 741.95	0.23
BT GROUP 2014-03	2 404 240	211 356	225 468	2 390 128	15 547 478.48	0.77
BUNZL 2049-12	99 180	3 384	6 818	95 746	2 476 451.89	0.12
BURBERRY GROUP	131 272	9 375	11 957	128 690	2 700 731.99	0.13
CAPITA 2049-12	195 888	12 837	19 778	188 947	3 473 506.74	0.17
CARNIVAL	54 251	2 226	3 145	53 332	2 633 513.98	0.13
CENTRICA 2014-03	1 438 295	126 488	143 321	1 421 462	5 141 720.89	0.25
COBHAM	332 786	15 902	23 366	325 322	1 362 560.38	0.07
COMPASS GROUP	484 813	32 522	43 137	474 198	7 299 779.50	0.36
CRODA INTERNATIONAL	39 577	4 564	5 182	38 959	1 675 775.22	0.08
DIAGEO	741 988	45 913	69 618	718 283	18 482 102.09	0.92
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		421 604	27 368	394 236	2 070 444.88	0.10
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	436 824	37 618	474 442			
DIXONS CARPHONE	284 765	31 131	35 130	280 766	1 801 500.26	0.09
EASYJET	46 592	2 315	3 766	45 141	1 129 964.93	0.06
FRESNILLO	65 924	2 091		68 015	627 705.84	0.03
G4S 2025-05	452 443	24 422	43 555	433 310	1 653 087.17	0.08
GKN	486 441	17 289	38 519	465 211	2 018 348.14	0.10
GLAXOSMITHKLINE	1 432 467	85 172	127 694	1 389 945	27 712 398.02	1.37
HAMMERSON	232 322	24 524	32 913	223 933	2 091 642.30	0.10
HERGREAVES LANSDOWN	70 495	9 013	5 842	73 666	1 232 620.21	0.06
HSBC HOLDINGS	5 655 585	329 339	409 965	5 574 959	43 009 817.49	2.13
ICAP 2049-12	163 914	5 563	14 193	155 284	1 048 788.42	0.05
IMI	79 100	6 127	10 005	75 222	1 161 320.00	0.06
IMPERIAL TOBACCO	282 703	19 518	28 857	273 364	12 844 009.57	0.64
INMARSAT	126 135	11 363	8 533	128 965	1 881 700.69	0.09
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	69 686	2 731	4 523	67 894	2 480 101.37	0.12
INTERTEK GROUP 2025-05	47 078	5 202	5 800	46 480	1 753 174.09	0.09
INTU PROPERTIES PLC	267 538	36 625	34 985	269 178	1 293 158.50	0.06
INVESTEC 2014-03	161 409	7 908	12 092	157 225	1 249 910.71	0.06
ITV 2049-12	1 132 634	56 169	94 064	1 094 739	4 073 873.78	0.20
J. SAINSBURY 2049-12	363 148	47 961	26 698	384 411	1 387 635.04	0.07
JOHNSON MATTHEY	60 706	3 217	5 137	58 786	2 365 107.33	0.12
KINGFISHER	700 203	49 665	84 982	664 886	3 522 498.18	0.17
LAND SECURITIES GROUP 2049-12	233 576	11 873	19 867	225 582	4 200 668.84	0.21
LEGAL & GENERAL GROUP	1 754 551	129 741	185 384	1 698 908	6 385 351.03	0.32
LLOYDS BANKING GROUP	16 721 778	1 059 458	1 471 495	16 309 741	18 770 915.90	0.93
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	66 890	30 323	8 204	89 009	3 336 138.99	0.17
LONMIN		35 159	35 159			
LONMIN INTERIM		3 258 158	3 258 158			
MARKS & SPENCER 2049-12	483 250	34 204	49 277	468 177	3 631 399.77	0.18
MEGGITT	234 789	9 812	19 095	225 506	1 601 216.99	0.08
MELROSE INDUSTRIES	291 386	14 261	24 554	281 093	1 116 274.40	0.06
MELROSE INDUSTRIES	313 801		313 801			

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
MERLIN ENTERTAINMENTS	146 025	87 289	32 499	200 815	1 160 370.95	0.06
MONDI		112 644	7 090	105 554	2 320 378.34	0.12
MORRISON (W.M.) SUPERMARKETS	612 399	67 576	42 477	637 498	1 597 674.88	0.08
NATIONAL GRID	1 101 245	74 698	107 924	1 068 019	13 662 733.60	0.68
NEXT 2049-12	45 308	1 980	5 741	41 547	4 909 567.61	0.24
OLD MUTUAL 2049-12	1 451 643	75 041	115 941	1 410 743	4 200 699.85	0.21
PEARSON 2014-02	242 344	12 014	19 566	234 792	3 956 606.67	0.20
PERSIMMON	90 524	3 478	4 977	89 025	2 784 587.88	0.14
PRUDENTIAL	758 045	43 827	67 442	734 430	15 489 461.28	0.77
RECKITT BENCKISER GROUP	189 960	12 153	18 567	183 546	15 716 318.73	0.78
RELX	327 978	32 297	39 058	321 217	4 992 573.72	0.25
REXAM	205 833	10 366	14 498	201 701	1 615 486.88	0.08
RIO TINTO 2049-12	375 884	25 083	39 478	361 489	12 839 233.07	0.64
ROLLS-ROYCE HOLDINGS	557 527	25 138	56 790	525 875	5 815 314.04	0.29
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -C- 07/2015		78 611 307	78 611 307			
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP 2049-12	747 573	265 901	87 612	925 862	4 637 970.87	0.23
ROYAL DUTCH SHELL -A-	1 150 817	86 663	143 284	1 094 196	27 585 095.97	1.37
ROYAL DUTCH SHELL -B-	720 827	44 054	67 631	697 250	17 697 197.17	0.88
ROYAL MAIL 2024-12	190 758	54 610	16 029	229 339	1 582 725.39	0.08
RSA INSURANCE GROUP	295 503	32 900	37 191	291 212	2 226 291.66	0.11
SABMILLER	285 659	19 398	27 991	277 066	12 585 252.74	0.62
SAGE GROUP	321 106	29 550	40 668	309 988	2 376 748.48	0.12
SCHRODERS	36 219	4 065	5 632	34 652	1 462 683.53	0.07
SEGRO PLC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	216 885	10 757	15 065	212 577	1 326 665.47	0.07
SEVERN TRENT	69 810	6 955	8 763	68 002	2 100 718.48	0.10
SMITH & NEPHEW 2014-02	263 980	13 843	22 255	255 568	4 420 749.06	0.22
SMITHS GROUP	114 962	16 870	20 457	111 375	1 870 214.13	0.09
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	77 835	5 433	8 153	75 115	887 067.87	0.04
SSE	295 396	13 354	25 123	283 627	6 205 401.95	0.31
ST JAMES'S PLACE CAPITAL		150 008		150 008	2 042 595.84	0.10
STANDARD CHARTERED	729 909	33 704	34 762	728 851	8 292 965.58	0.41
STANDARD LIFE		615 827	53 034	562 793	3 483 020.87	0.17
STANDARD LIFE	707 559		707 559			
TATE & LYLE 2024-09	136 648	6 730	11 935	131 443	1 059 610.91	0.05
TAYLOR WIMPEY 2023-08		997 883	84 555	913 328	2 734 514.43	0.14
TESCO	2 400 210	109 569	183 728	2 326 051	6 619 990.61	0.33
TRAVIS PERKINS 2022-12	73 265	2 993	4 750	71 508	2 178 182.47	0.11
TULLOW OIL 2049-12	266 828	12 118	31 413	247 533	821 744.82	0.04
UNILEVER	379 080	24 702	37 051	366 731	14 307 230.93	0.71
UNITED UTILITIES GROUP	201 953	10 882	17 846	194 989	2 479 624.40	0.12
VODAFONE GROUP	7 826 844	464 496	717 458	7 573 882	25 537 579.32	1.27
WEIR GROUP	62 183	6 859	8 236	60 806	1 269 764.61	0.06
WHITBREAD 2014-02	53 532	3 597	5 149	51 980	3 708 648.45	0.18
WILLIAM HILL	253 947	32 185	35 130	251 002	1 343 969.33	0.07
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					644 167 045.22	31.94
					1 912 186 023.71	94.80
Effekten ohne Markt						
Oesterreich						
IMMOEAST (rights) 31.12.2099 2049-12	30 319			30 319		
					0.00	0.00
Total Beteiligungspapiere					0.00	0.00
Total Effekten ohne Markt					0.00	0.00
Andere Anlagen						
Financial Futures						
Deutschland						
EURO STOXX 50 INDEX 20/03/2015	529	159	688			
EURO STOXX 50 INDEX 19/06/2015		1 760	1 760			
EURO STOXX 50 INDEX 18/09/2015		1 639	1 221	418		
					0.00	0.00
Vereinigtes Königreich						
FTSE 100 INDEX 20/03/2015	163	47	210			
FTSE 100 INDEX 19/06/2015		561	561			
FTSE 100 INDEX 18/09/2015		511	378	133		
					0.00	0.00
Total Financial Futures					0.00	0.00
Total Andere Anlagen					0.00	0.00
Total Anlagen					1 912 186 023.71	94.80
Bankguthaben auf Sicht					98 430 887.17	4.88
Sonstige Vermögenswerte					6 364 824.32	0.32
Gesamtfondsvermögen (GFV)					2 016 981 735.20	100.00
./. Bankverbindlichkeiten					75 416 065.84	3.74
./. Andere Verbindlichkeiten					14 045.13	0.00
Nettofondsvermögen					1 941 551 624.23	96.26

¹ Umfassen Käufe und Verkäufe sowie Corporate Actions

Gemäss § 18 des Fondsreglements wurden in der Berichtsperiode folgende Anteile gegen Effekten statt in bar ausgegeben bzw. zurückgenommen:

Klasse	Datum	Anteile	Währung	NAV	Ausgabe	Rücknahme
Z	13.05.2015	2 366.052	CHF	1 397.86	x	
Z	20.07.2015	886.599	CHF	1 444.52	x	
Z	20.07.2015	681.627	CHF	1 444.52	x	
Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. März 2015 bis zum 31. August 2015						
Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen- Währung	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung
07.04.2015	Kauf	GBP	3 400 000.00	CHF	4 875 600.00	
07.04.2015	Kauf	EUR	2 600 000.00	CHF	2 706 860.00	
05.05.2015	Kauf	CHF	3 622 250.00	GBP	2 500 000.00	
Total Devisentermingeschäfte						0.00
						0.00

Kurze Übersicht

Kennzahlen		31.08.2015	28.02.2015	28.02.2014
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	2 309.2	2 525.3	2 559.2
Anteilklasse D				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	203.1	360.5	461.9
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 048.14	1 064.06	1 007.77
Anteilklasse F				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	24.5	18.8	15.0
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 107.35	1 123.81	1 065.01
Anteilklasse Z				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	2 081.6	2 146.0	2 082.3
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 134.76	1 152.46	1 091.93

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.08.2015
EURO	1.083600
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000

**Vermögens-
rechnung per
31. August 2015**

	31.08.2015 CHF	Konsolidierung 28.02.2015 CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
– Sichtguthaben	755 325.31	6 335 158.13
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2 287 684 137.30	2 490 685 809.70
Sonstige Vermögenswerte	20 755 912.83	28 260 804.91
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	2 309 195 375.44	2 525 281 772.74
Andere Verbindlichkeiten	18 030.28	25 436.82
Nettofondsvermögen	2 309 177 345.16	2 525 256 335.92
Anzahl Anteile im Umlauf	2 050 275.587	2 217 594.953

	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	Konsolidierung 01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	2 525 256 335.92	2 559 181 727.04
Ordentliche Jahresausschüttung / Ablieferung VST	–50 104 646.09	–55 493 269.91
Ausgaben von Anteilen	93 100 398.08	428 149 399.08
Rücknahmen von Anteilen	–268 038 771.64	–611 973 503.18
Sonstiges aus Anteilverkehr	2 260 796.19	24 152 533.74
Gesamterfolg	6 703 232.70	181 239 449.15
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	2 309 177 345.16	2 525 256 335.92
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	2 217 594.953	2 379 399.483
Ausgegebene Anteile	82 591.457	390 847.415
Zurückgenommene Anteile	–249 910.823	–552 651.945
Bestand am Ende der Berichtsperiode	2 050 275.587	2 217 594.953

Inventarwert pro Anteil
Ausserbilanzgeschäfte

Keine

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
360 504 570.65	461 899 820.50	18 767 697.59	14 974 198.25	2 145 984 067.68	2 082 307 708.29
–6 701 433.47	–9 664 377.13	–390 759.71	–286 706.28	–43 012 452.91	–45 542 186.50
15 883 474.99	26 607 808.77	7 395 228.37	27 319 147.92	69 821 694.72	374 222 442.39
–166 599 490.81	–150 413 088.13	–1 358 969.85	–24 376 376.50	–100 080 310.98	–437 184 038.55
–461 670.35	6 424 914.39	13 614.24	–199 370.40	2 708 852.30	17 926 989.75
489 677.39	25 649 492.25	62 274.22	1 336 804.60	6 151 281.09	154 253 152.30
203 115 128.40	360 504 570.65	24 489 084.86	18 767 697.59	2 081 573 131.90	2 145 984 067.68
338 801.768	458 338.284	16 700.003	14 060.100	1 862 093.182	1 907 001.099
15 131.914	26 128.898	6 651.175	25 225.623	60 808.368	339 492.894
–160 148.219	–145 665.414	–1 236.076	–22 585.720	–88 526.528	–384 400.811
193 785.463	338 801.768	22 115.102	16 700.003	1 834 375.022	1 862 093.182
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
1 048.14	1 064.06	1 107.35	1 123.81	1 134.76	1 152.46

**Erfolgsrechnung
für die Zeit vom
1. März 2015 bis
zum 31. August
2015**

	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	Konsolidierung 01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	0.00	4 768.92
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige		
Forderungswertpapiere und -rechte	22 892 543.48	53 736 794.11
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	332 965.61	4 675 900.87
Total Erträge abzüglich	23 225 509.09	58 417 463.90
Passivzinsen	0.12	75.90
Negativzinsen	10 129.43	0.00
Reglementarische Vergütung an:		
– die Fondsleitung	149 141.50	386 304.46
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	1 506 373.62	8 460 798.92
Nettoertrag	21 559 864.42	49 570 284.62
Realisierte Kapitalgewinne	14 157 613.65	39 734 821.09
Realisierte Kapitalverluste	–2 245 536.18	–11 168 375.01
Realisierter Erfolg	33 471 941.89	78 136 730.70
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	–26 768 709.19	103 102 718.45
Gesamterfolg	6 703 232.70	181 239 449.15

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
0.00	797.20	0.00	33.48	0.00	3 938.24
2 951 246.80	8 845 361.57	201 530.81	362 249.45	19 739 765.87	44 529 183.09
64 747.26	235 933.67	33 775.43	275 549.13	234 442.92	4 164 418.07
3 015 994.06	9 082 092.44	235 306.24	637 832.06	19 974 208.79	48 697 539.40
0.00	11.26	0.00	0.42	0.12	64.22
1 001.40	0.00	103.58	0.00	9 024.45	0.00
132 850.02	359 654.22	16 291.48	26 650.24	0.00	0.00
1 070 098.56	1 906 298.36	7 142.16	266 531.89	429 132.90	6 287 968.67
1 812 044.08	6 816 128.60	211 769.02	344 649.51	19 536 051.32	42 409 506.51
1 833 642.94	5 934 944.81	142 236.59	312 124.29	12 181 734.12	33 487 751.99
–783 012.29	–1 856 339.80	–15 906.23	–99 748.74	–1 446 617.66	–9 212 286.47
2 862 674.73	10 894 733.61	338 099.38	557 025.06	30 271 167.78	66 684 972.03
–2 372 997.34	14 754 758.64	–275 825.16	779 779.54	–24 119 886.69	87 568 180.27
489 677.39	25 649 492.25	62 274.22	1 336 804.60	6 151 281.09	154 253 152.30

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Obligationen							
Australien							
2	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2%/10-08.07.	4 750 000		4 750 000			
2.625	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2.625%/11-27	750 000			750 000	796 125.00	0.03
1.5	COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA 1.5%/12-13.09.2019	1 500 000			1 500 000	1 601 250.00	0.07
0.875	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875%/13-11.02.202	1 530 000			1 530 000	1 589 670.00	0.07
1	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1%/13-25.09.2018	2 230 000		1 500 000	730 000	752 630.00	0.03
1.5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.5%/14-07.02.2022	1 680 000			1 680 000	1 819 440.00	0.08
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3%/09-09.11.2017	4 120 000	500 000		4 620 000	4 922 610.00	0.21
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/13-17.04.2020	3 330 000			3 330 000	3 481 515.00	0.15
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/14-10.12.2021	1 500 000			1 500 000	1 580 250.00	0.07
1.625	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.625%/13-05.09.2023	2 050 000			2 050 000	2 258 075.00	0.10
2.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.125%/11-03.02.2017	1 350 000			1 350 000	1 391 850.00	0.06
2.25	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.25%/10-14.07.2017	5 100 000	500 000		5 600 000	5 840 800.00	0.25
0.5	WESTPAC BANKING 0.5%/15-02.02.2022	500 000	200 000		700 000	714 000.00	0.03
2	WESTPAC BANKING 2%/11-15.12.2016	1 000 000			1 000 000	1 026 400.00	0.04
2.5	WESTPAC BANKING 2.5%/10-16.02.2017	1 170 000			1 170 000	1 213 290.00	0.05
3.125	WESTPAC BANKING 3.125%/09-21.12.2018	4 040 000			4 040 000	4 452 080.00	0.19
						33 439 985.00	1.45
Cayman-Inseln							
2.375	NEW YORK LIFE FUNDING 2.375%/06-22.02.2016	260 000		260 000			
						0.00	0.00
Deutschland							
2.75	BERLIN 2.75%/07-03.05.2017	4 000 000		1 000 000	3 000 000	3 169 500.00	0.14
2.5	DEUTSCHE HYPOTHEKENBANK 2.5%/06-08.03.2018	2 820 000			2 820 000	3 007 530.00	0.13
2.125	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK 2.125%/09-02.11.2016	3 000 000			3 000 000	3 066 900.00	0.13
2.5	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK 2.5%/05-09.03.2017	765 000			765 000	791 010.00	0.03
3.125	EUROHYPO 3.125%/06-14.07.2025	2 610 000			2 610 000	3 263 805.00	0.14
3	HSB NORDBANK 3%/07-14.06.2019	550 000			550 000	618 200.00	0.03
2.5	KFW 2.5%/05-25.08.2025	8 785 000		3 600 000	5 185 000	6 411 252.50	0.28
3.375	KFW 3.375%/07-30.08.2017	9 120 000		700 000	8 420 000	9 106 230.00	0.39
2.625	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.625%/09-07.07.2016	570 000		570 000			
1.75	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 1.75%/10-16.01.2017	2 800 000			2 800 000	2 889 040.00	0.13
2.125	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.125%/05-29.08.201	960 000			960 000	1 012 320.00	0.04
3	MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 3%/07-12.06.2017	3 030 000			3 030 000	3 205 740.00	0.14
2.25	NORDRHEIN-WESTFALEN 2.25%/06-01.03.2019	670 000	900 000		1 570 000	1 721 505.00	0.07
0.875	NORTH RHINE-WESTPHALIA 0.875%/14-29.07.2024	400 000			400 000	427 600.00	0.02
1.625	STATE OF HESSE 1.625%/10-29.09.2016	500 000			500 000	511 600.00	0.02
3.25	STATE OF HESSEN 3.25%/08-22.05.2017	2 000 000			2 000 000	2 134 000.00	0.09
						41 336 232.50	1.79
Dänemark							
2.375	DANSKE BANK 2.375%/09-13.01.2017	4 000 000			4 000 000	4 149 600.00	0.18
2.625	KOMMUNEKREDIT 2.625%/06-17.10.2016	1 750 000			1 750 000	1 812 475.00	0.08
2.875	KOMMUNEKREDIT 2.875%/06-13.10.2031	5 220 000	500 000		5 720 000	7 876 440.00	0.34
						13 838 515.00	0.60
Finnland							
0.75	MUNICIPALITY FINANCE 0.75%/14-17.09.2024	700 000			700 000	737 800.00	0.03
0.875	MUNICIPALITY FINANCE 0.875%/13-01.02.2023	170 000	1 700 000		1 870 000	1 995 290.00	0.09
1.375	MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	100 000			100 000	112 400.00	0.00
1.625	MUNICIPALITY FINANCE 1.625%/11-07.02.2018	1 250 000			1 250 000	1 318 750.00	0.06
2.25	MUNICIPALITY FINANCE 2.25%/10-10.12.2019	1 350 000			1 350 000	1 507 275.00	0.07
2.375	MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/11-30.03.2026	4 450 000		100 000	4 350 000	5 333 100.00	0.23
3	MUNICIPALITY FINANCE 3%/09-15.04.2021	400 000			400 000	474 200.00	0.02
						11 478 815.00	0.50
Frankreich							
2.625	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 2.625%/10-18.02.	2 500 000			2 500 000	3 062 500.00	0.13
3	ASSISTANCE PUBLIQUE DES HOPITAUX DE PARIS 3%/08-21	500 000			500 000	519 300.00	0.02
2.375	CADES 2.375%/11-19.04.2023	4 000 000			4 000 000	4 722 000.00	0.20
3	CADES 3%/09-21.04.2021	1 560 000			1 560 000	1 834 560.00	0.08
2.5	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 2.5%/11	500 000			500 000	610 500.00	0.03
1.125	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.125%/12-21.	4 500 000		2 000 000	2 500 000	2 577 500.00	0.11
1.625	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.625%/12-05.	4 200 000			4 200 000	4 494 000.00	0.19
1.75	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.75%/13-26.0	400 000			400 000	458 400.00	0.02
1.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.25%/13-16.12.	1 600 000		1 000 000	600 000	645 900.00	0.03
3.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.25%/07-13.11.	760 000			760 000	822 700.00	0.04
3.625	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.625%/08-16.04	1 400 000			1 400 000	1 549 100.00	0.07
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-09.08.2017	2 600 000			2 600 000	2 797 600.00	0.12
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-28.08.2019	675 000			675 000	774 225.00	0.03
2.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.5%/09-02.0	960 000			960 000	1 034 880.00	0.04
2.625	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.625%/09-12	2 270 000			2 270 000	2 525 375.00	0.11
2	CFF 2%/10-20.12.2017	1 750 000			1 750 000	1 845 375.00	0.08
2.25	CFF 2.25%/10-13.10.2021	2 000 000		200 000	1 800 000	2 056 500.00	0.09
2.25	CFF 2.25%/11-09.08.2019	1 350 000			1 350 000	1 482 300.00	0.06
2.375	CFF 2.375%/05-24.08.2018	15 420 000			15 420 000	16 661 310.00	0.72
2.5	CFF 2.5%/06-24.02.2031	2 975 000			2 975 000	3 796 100.00	0.16
2.75	CFF 2.75%/04-15.11.2016	1 550 000		1 550 000			
2.875	CFF 2.875%/09-10.09.2019	1 400 000			1 400 000	1 577 100.00	0.07
3	CFF 3%/07-07.06.2022	2 315 000			2 315 000	2 773 370.00	0.12
3	CFF 3%/08-19.08.2016	2 450 000		2 450 000			
2	CIF EUROMORTGAGE 2%/10-30.01.2019	750 000			750 000	804 000.00	0.03
2.375	CIF EUROMORTGAGE 2.375%/10-05.03.2019	1 180 000			1 180 000	1 283 840.00	0.06
1	COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1%/14-06.03.202		500 000		500 000	537 500.00	0.02
0.5	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.5%/15-16.03.2027		1 000 000	1 000 000			
1.125	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.125%/14-05.06.2024	1 500 000			1 500 000	1 619 250.00	0.07
1.125	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.125%/14-12.08.2021	1 500 000		200 000	1 300 000	1 389 050.00	0.06
1.375	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.375%/12-30.07.2018	4 000 000			4 000 000	4 194 000.00	0.18
1.75	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 1.75%/10-27.07.2017	1 000 000			1 000 000	1 043 000.00	0.05
1.375	CRH 1.375%/13-15.03.2023	1 850 000			1 850 000	2 020 200.00	0.09
1.75	CRH 1.75%/11-29.03.2016	500 000		500 000			
1.875	CRH 1.875%/12-23.05.2022	3 500 000			3 500 000	3 920 000.00	0.17
2.375	CRH 2.375%/12-05.03.2024	360 000			360 000	424 980.00	0.02

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.5	CRH 2.5%/11-29.03.2021	3 400 000		300 000	3 100 000	3 541 750.00	0.15
2	HSBC SFH FRANCE 2%/10-23.04.2019	1 000 000		500 000	500 000	541 250.00	0.02
2.375	HSBC SFH FRANCE 2.375%/10-07.09.2018	700 000			700 000	757 400.00	0.03
2.375	ILE DE FRANCE 2.375%/05-28.12.2016	2 830 000			2 830 000	2 936 125.00	0.13
3.25	ILE DE FRANCE 3.25%/07-27.11.2018	1 200 000			1 200 000	1 341 600.00	0.06
3.25	PARIS 3.25%/08-05.11.2018	1 000 000			1 000 000	1 114 000.00	0.05
2.625	RATP 2.625%/06-06.11.2019	7 785 000			7 785 000	8 656 920.00	0.37
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/07-0	900 000			900 000	969 750.00	0.04
2.625	SCNF RESEAU 2.625%/11-10.03.2031	500 000			500 000	646 750.00	0.03
3	SCNF RESEAU 3%/09-24.04.2019	3 680 000			3 680 000	4 127 120.00	0.18
3.25	SCNF RESEAU 3.25%/06-30.06.2032	6 080 000			6 080 000	8 615 360.00	0.37
2.375	SNCF MOBILITES 2.375%/09-24.07.2019	850 000			850 000	933 725.00	0.04
2.625	SNCF MOBILITES 2.625%/06-13.12.2021	700 000			700 000	810 950.00	0.04
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-11.06.2018	5 800 000		1 370 000	4 430 000	4 795 475.00	0.21
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-23.01.2019	3 150 000			3 150 000	3 468 150.00	0.15
2.875	SNCF RESEAU 2.875%/09-26.02.2021	950 000			950 000	1 105 800.00	0.05
2.375	TOTAL CAPITAL 2.375%/06-13.01.2016	400 000		400 000			
3.125	TOTAL CAPITAL 3.125%/06-28.06.2018	3 205 000		1 300 000	1 905 000	2 082 165.00	0.09
1	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 1%/14-29.08.2024	6 850 000			6 850 000	7 165 100.00	0.31
						129 465 805.00	5.61
Internationale Organisationen							
2.625	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.625%/09-25.03.2019	580 000			580 000	644 090.00	0.03
2.75	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75%/10-12.02.2030	2 390 000			2 390 000	3 170 335.00	0.14
1.625	BEI 1.625%/12-02.04.2026	600 000			600 000	690 300.00	0.03
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/12-11.09.2018	160 000	3 500 000	160 000	3 500 000	3 673 250.00	0.16
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/13-13.08.2020	2 310 000			2 310 000	2 470 545.00	0.11
2	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024	2 550 000	500 000		3 050 000	3 423 625.00	0.15
3.375	COUNCIL OF EUROPE 3.375%/08-06.11.2020	3 930 000		300 000	3 630 000	4 343 295.00	0.19
1.125	EIB 1.125%/12-26.04.2023		200 000		200 000	218 100.00	0.01
1.25	EIB 1.25%/12-02.08.2019	400 000			400 000	428 400.00	0.02
1.375	EIB 1.375%/13-21.02.2028	1 500 000			1 500 000	1 703 250.00	0.07
1.5	EIB 1.5%/12-02.08.2024	300 000			300 000	338 700.00	0.01
1.625	EIB 1.625%/11-23.11.2023	5 200 000			5 200 000	5 899 400.00	0.26
1.75	EIB 1.75%/10-21.04.2017	1 800 000			1 800 000	1 869 300.00	0.08
2	EIB 2%/05-29.08.2016	3 210 000		2 500 000	710 000	728 247.00	0.03
2	EIB 2%/10-24.08.2022	4 950 000			4 950 000	5 694 975.00	0.25
2.125	EIB 2.125%/10-22.01.2020	1 050 000			1 050 000	1 173 900.00	0.05
2.375	EIB 2.375%/05-10.07.2020	16 730 000		2 200 000	14 530 000	16 549 670.00	0.72
2.5	EIB 2.5%/07-08.02.2019	6 870 000			6 870 000	7 611 960.00	0.33
2.625	EIB 2.625%/10-11.02.2025	2 220 000		100 000	2 120 000	2 621 380.00	0.11
3	EIB 3%/09-14.04.2021		500 000		500 000	594 500.00	0.03
3.125	EIB 3.125%/06-30.06.2036	7 130 000	2 000 000	5 100 000	4 030 000	6 065 150.00	0.26
3.25	EIB 3.25%/08-30.04.2018	80 000			80 000	88 480.00	0.00
3.375	EIB 3.375%/07-15.10.2027	2 635 000			2 635 000	3 607 315.00	0.16
						73 608 167.00	3.19
Kanada							
2.875	BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.11.2018	1 495 000			1 495 000	1 662 440.00	0.07
2.875	BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.12.2017	3 300 000			3 300 000	3 564 000.00	0.15
1.75	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE LONDON 1.75%/10	4 250 000			4 250 000	4 420 000.00	0.19
2.625	EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.625%/09-24.07.2017	2 600 000			2 600 000	2 765 100.00	0.12
2.375	PROVINCE OF ONTARIO 2.375%/10-07.05.2020	4 550 000		4 550 000			
2.5	PROVINCE OF ONTARIO 2.5%/09-04.12.2019	4 100 000		4 100 000			
3.375	PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-27.05.2016	100 000		100 000			
3.75	PROVINCE OF ONTARIO 3.75%/08-30.07.2018	100 000		100 000			
0.625	ROYAL BANK OF CANADA 0.625%/14-09.04.2019	1 500 000			1 500 000	1 535 250.00	0.07
2.25	ROYAL BANK OF CANADA 2.25%/11-21.04.2021	4 400 000		300 000	4 100 000	4 659 650.00	0.20
0.75	ROYAL BK CANADA TORONTO BRANCH 0.75%/13-23.10.2018	2 000 000		1 450 000	550 000	563 200.00	0.02
						19 169 640.00	0.83
Luxemburg							
0.313	BAVARIAN SKY -A- 0.313%/13-15.05.2016	320 000		320 000			
1.625	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/14-04.02.25	2 700 000			2 700 000	3 087 450.00	0.13
						3 087 450.00	0.13
Neuseeland							
1.125	AUCKLAND COUNCIL 1.125%/13-07.02.2024	1 000 000	1 000 000		2 000 000	2 172 000.00	0.09
1.5	BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.5%/12-22.01.2018	1 000 000			1 000 000	1 036 500.00	0.04
						3 208 500.00	0.14
Niederlande							
1.5	ABN AMRO BANK 1.5%/12-18.07.2023	1 000 000			1 000 000	1 104 500.00	0.05
1.625	ABN AMRO BANK 1.625%/10-28.10.2016	900 000		900 000			
2.25	ABN AMRO BANK 2.25%/11-10.07.2018	3 000 000		1 300 000	1 700 000	1 822 400.00	0.08
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/06-30.12.2015	45 000			45 000	45 463.50	0.00
2.625	ABN AMRO BANK 2.625%/11-27.04.2021	1 000 000			1 000 000	1 143 000.00	0.05
3.375	ABN AMRO BANK 3.375%/06-15.08.2031	2 900 000			2 900 000	4 115 100.00	0.18
3.5	ACHMEA BANK 3.5%/07-22.08.2017	1 000 000			1 000 000	1 069 500.00	0.05
2.125	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN 2.125%/10-09.11.2029	250 000			250 000	307 250.00	0.01
2.25	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN 2.25%/11-23.02.2021	2 900 000		300 000	2 600 000	2 969 200.00	0.13
1.25	BNG 1.25%/14-30.04.2024	1 000 000			1 000 000	1 102 000.00	0.05
2.125	BNG 2.125%/10-06.11.2018	1 050 000			1 050 000	1 139 250.00	0.05
2.25	BNG 2.25%/05-14.10.2020	9 910 000		5 900 000	4 010 000	4 565 385.00	0.20
2.375	BNG 2.375%/10-19.11.2019	3 000 000			3 000 000	3 363 000.00	0.15
2.5	BNG 2.5%/05-21.07.2025	8 000 000		2 500 000	5 700 000	7 005 300.00	0.30
2.5	BNG 2.5%/09-14.10.2019	2 770 000			2 770 000	3 113 480.00	0.13
2.625	BNG 2.625%/07-09.02.2017	3 000 000			3 000 000	3 139 500.00	0.14
2.75	BNG 2.75%/09-11.05.2016	500 000		500 000			
3.125	BNG 3.125%/07-02.07.2018	1 810 000		1 300 000	510 000	565 590.00	0.02
1.375	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.375%/13-24.07.2023		200 000		200 000	219 200.00	0.01
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/11-18.12.2017	750 000			750 000	783 000.00	0.03
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/12-21.02.2024	1 000 000			1 000 000	1 101 500.00	0.05
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/14-26.08.2024	3 000 000			3 000 000	3 313 500.00	0.14
1.75	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.75%/10-03.06.2020	10 800 000		400 000	10 400 000	11 362 000.00	0.49
0.5	EBN 0.5%/14-22.09.2022	1 000 000			1 000 000	1 034 000.00	0.04
0.875	EBN 0.875%/14-22.09.2026	2 800 000			2 800 000	2 935 800.00	0.13
1.625	EBN 1.625%/11-03.10.2023	750 000			750 000	838 500.00	0.04
2.125	EBN 2.125%/10-27.04.2020	7 130 000		300 000	6 830 000	7 536 905.00	0.33

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.875	NEDERLANDSE FINANCIERINGS-MAATSCHAPPIJ VOOR ONTWIK	5 000 000		5 000 000			
1.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.25%/12-09.08.2024	2 000 000			2 000 000	2 201 000.00	0.10
1.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.375%/12-13.09.2027	1 000 000			1 000 000	1 123 000.00	0.05
1.75	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.75%/10-22.07.2016	700 000		700 000			
2	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2%/10-10.10.2017	1 450 000			1 450 000	1 529 025.00	0.07
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.25%/10-03.09.2019	2 600 000			2 600 000	2 888 600.00	0.13
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.25%/11-24.02.2021	400 000			400 000	456 800.00	0.02
2.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.375%/05-19.08.2020	4 900 000		4 300 000	600 000	683 400.00	0.03
2.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.375%/06-27.01.2023	5 315 000			5 315 000	6 271 700.00	0.27
2.5	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.5%/06-27.12.2018	1 000 000			1 000 000	1 102 500.00	0.05
2.625	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.625%/07-07.02.2022	1 450 000		300 000	1 150 000	1 361 600.00	0.06
3.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 3.25%/06-07.08.2029	3 595 000			3 595 000	4 964 695.00	0.21
1.125	NV BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN BNG 1.125%/13-19.04.	1 200 000			1 200 000	1 304 400.00	0.06
0.375	SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.375%/15-21.08.2023		4 000 000		4 000 000	4 010 000.00	0.17
0.875	SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.875%/15-21.08.2028		3 400 000		3 400 000	3 403 400.00	0.15
						96 994 443.50	4.20
Norwegen							
1.5	DNB BOLIGKREDITT 1.5%/11-24.02.2017	1 500 000			1 500 000	1 543 500.00	0.07
2.25	DNB BOLIGKREDITT 2.25%/10-26.03.2018	3 530 000			3 530 000	3 771 805.00	0.16
3.375	DNB BOLIGKREDITT 3.375%/07-16.11.2016	3 870 000			3 870 000	4 051 890.00	0.18
2.875	KOMMUNALBANKEN 2.875%/09-09.05.2017	6 000 000			6 000 000	6 348 000.00	0.27
1.375	NORWEGIAN RAILWAYS 1.375%/10-15.11.2017	3 000 000			3 000 000	3 120 000.00	0.14
2.125	NORWEGIAN RAILWAYS 2.125%/11-14.02.2020	3 950 000		300 000	3 650 000	3 991 275.00	0.17
						22 826 470.00	0.99
Oesterreich							
2.5	AUSTRIA 2.5%/09-14.07.2016	6 240 000		6 240 000			
4.5	BAWAG PSK 4.5%/00-16.10.2015	1 500 000			1 500 000	1 507 500.00	0.07
2.125	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 2.125%/05-12.	250 000		250 000			
3.25	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/07-16.0	7 160 000			7 160 000	8 090 800.00	0.35
2.75	ERSTE GROUP BANK 2.75%/07-10.12.2015	1 000 000		1 000 000			
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-15.03.2017	4 325 000			4 325 000	4 346 625.00	0.19
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-26.08.2020	3 095 000		500 000	2 595 000	2 595 000.00	0.11
2.5	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.5%/06-14.02.2022	2 780 000			2 780 000	2 736 910.00	0.12
3.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 3.375%/06-22.06.2026	1 500 000			1 500 000	1 512 750.00	0.07
2.125	LAND NIEDEROESTERREICH 2.125%/10-15.08.2017	2 470 000			2 470 000	2 586 090.00	0.11
1.75	OEKB 1.75%/11-14.06.2017	500 000			500 000	520 000.00	0.02
1.75	OEKB 1.75%/12-24.05.2023	1 000 000			1 000 000	1 132 000.00	0.05
2.125	OEKB 2.125%/05-18.10.2018	4 190 000		1 365 000	2 825 000	3 055 237.50	0.13
2.125	OEKB 2.125%/11-23.07.2019	400 000			400 000	440 000.00	0.02
2.625	OEKB 2.625%/06-22.11.2024	7 035 000			7 035 000	8 614 357.50	0.37
2.75	OEKB 2.75%/05-28.01.2020	4 905 000			4 905 000	5 603 962.50	0.24
2.875	OEKB 2.875%/05-25.02.2030	9 590 000			9 590 000	12 764 290.00	0.55
3	OEKB 3%/07-14.06.2022	1 060 000		300 000	760 000	919 980.00	0.04
3	OEKB 3%/08-06.10.2016	1 200 000			1 200 000	1 245 360.00	0.05
1	RAIFFEISEN LANDESBANK NIEDEROESTERREICH-WIEN 1%/12	2 300 000			2 300 000	2 375 900.00	0.10
2.625	VORARLBERGER LHB 2.625%/09-30.10.2019	750 000			750 000	823 875.00	0.04
						60 870 637.50	2.64
Schweden							
2.125	AKADEMISKA HUS 2.125%/10-04.07.2018	2 400 000		1 400 000	1 000 000	1 075 500.00	0.05
2.25	AKADEMISKA HUS 2.25%/11-22.02.2021	750 000			750 000	850 125.00	0.04
2.625	KOMMUNINVEST I SVERIGE 2.625%/07-07.12.2016	1 180 000			1 180 000	1 227 436.00	0.05
1.25	KOMMUNINVEST I SVERIGE AB 1.25%/12-28.02.2022	1 400 000		200 000	1 200 000	1 305 000.00	0.06
1.5	LANDSHYPOTEK 1.5%/11-24.10.2018	3 160 000			3 160 000	3 346 440.00	0.14
1	LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 1%/12-29.05.2019	1 230 000		1 000 000	230 000	239 545.00	0.01
1.125	LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB 1.125%/13-11.04.2023	1 000 000			1 000 000	1 075 500.00	0.05
0.55	NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025		1 000 000		1 000 000	1 008 000.00	0.04
0.75	NORDEA BANK 0.75%/14-04.10.2019	2 000 000			2 000 000	2 060 000.00	0.09
0.875	NORDEA BANK 0.875%/13-25.09.2018	1 000 000	2 000 000	1 000 000	2 000 000	2 055 000.00	0.09
1.125	NORDEA BANK 1.125%/12-02.10.2020	1 250 000			1 250 000	1 317 500.00	0.06
1.5	NORDEA BANK 1.5%/12-29.09.2017	2 600 000	500 000		3 100 000	3 200 750.00	0.14
2.75	NORDEA BANK 2.75%/11-22.03.2021	1 350 000			1 350 000	1 551 150.00	0.07
2.25	NORDEA BANK AB 2.25%/10-06.05.2016	4 290 000		4 290 000			
1.875	NORDEA HYPOTEK 1.875%/10-07.06.2016	2 805 000		2 805 000			
2.125	SCBC 2.125%/10-15.02.2017	1 750 000			1 750 000	1 816 500.00	0.08
2	STADSHYPOTEK 2%/10-01.12.2016	2 100 000		100 000	2 000 000	2 064 000.00	0.09
0.625	SVENSKA HANDELSBANKEN 0.625%/14-11.12.2018	1 500 000		1 500 000			
1.25	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/13-20.12.2019	500 000			500 000	526 750.00	0.02
1.375	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.375%/12-05.10.2022	1 800 000			1 800 000	1 951 200.00	0.08
1.625	SWEDBANK MORTGAGE 1.625%/10-08.12.2017	250 000			250 000	261 625.00	0.01
2.125	SWEDBANK MORTGAGE 2.125%/10-26.08.2016	1 000 000		1 000 000			
2.5	SWEDBANK MORTGAGE 2.5%/11-03.06.2022	500 000			500 000	585 500.00	0.03
2.125	SWEDISH COVERED BOND CORPORATION 2.125%/09-08.06.2	4 020 000		4 020 000			
1.875	SWEDISH EXPORT CREDIT 1.875%/10-08.03.2017	500 000			500 000	518 750.00	0.02
2.625	SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/07-09.02.2017	10 160 000			10 160 000	10 632 440.00	0.46
						38 668 711.00	1.67
Schweiz							
0.625	AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.625%/15-13.04.2028		1 000 000		1 000 000	1 004 500.00	0.04
0.875	AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.875%/15-23.01.2030	7 500 000		1 000 000	6 500 000	6 662 500.00	0.29
1	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1%/14-19.06.2023	1 400 000			1 400 000	1 488 200.00	0.06
1.125	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.125%/11-15.11.2018	1 450 000		1 420 000	30 000	31 305.00	0.00
1.6	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.6%/12-18.05.2037	200 000			200 000	229 500.00	0.01
2	AARGAUISCHE KANTONALBANK 2%/09-09.09.2016	1 300 000			1 300 000	1 331 330.00	0.06
3.5	AARGAUISCHE KANTONALBANK 3.5%/08-14.08.2017	3 200 000			3 200 000	3 435 200.00	0.15
2.25	BANQUE CANTONALE DE FRIBOURG 2.25%/11-14.06.2021	1 000 000			1 000 000	1 129 500.00	0.05
1.625	BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.625%/11-30.11.2026		1 000 000		1 000 000	1 121 000.00	0.05
0.25	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.25%/15-13.05.2		1 000 000		1 000 000	984 500.00	0.04
0.625	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.625%/12-27.02.	2 020 000		1 000 000	1 020 000	1 042 440.00	0.05
0.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.75%/15-30.03.2		1 500 000		1 500 000	1 538 250.00	0.07
1	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1%/12-04.10.2022	250 000			250 000	265 750.00	0.01
1.125	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.125%/13-27.03.	3 500 000			3 500 000	3 755 500.00	0.16
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/10-09.11.2	2 100 000			2 100 000	2 294 250.00	0.10
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/10-25.06.2	2 800 000			2 800 000	3 001 600.00	0.13

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/11-22.11.2	1 130 000			1 130 000	1 276 335.00	0.06
2.5	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 2.5%/09-16.12.20	3 100 000			3 100 000	3 451 850.00	0.15
1.5	BASLER KANTONALBANK 1.5%/10-26.10.2018	720 000		720 000			
1.5	BASLER KANTONALBANK 1.5%/12-02.03.2027	1 500 000			1 500 000	1 665 750.00	0.07
1.875	BASLER KANTONALBANK 1.875%/10-26.10.2026	500 000			500 000	577 000.00	0.02
2.5	BASLER KANTONALBANK 2.5%/06-24.03.2021	5 865 000		300 000	5 565 000	6 346 882.50	0.27
2.75	BASLER KANTONALBANK 2.75%/04-22.12.2016	3 390 000			3 390 000	3 526 617.00	0.15
3.25	BASLER KANTONALBANK 3.25%/07-29.06.2022	3 230 000			3 230 000	3 927 680.00	0.17
2.875	BERNER KANTONALBANK 2.875%/04-22.04.2016	700 000		700 000			
0.625	CANTON OF GENEVA 0.625%/14-30.07.2021	1 000 000			1 000 000	1 043 500.00	0.05
1.625	CANTON OF GENEVA 1.625%/14-30.07.2029	6 100 000		500 000	5 600 000	6 381 200.00	0.28
2	CANTON OF GENEVA 2%/11-28.11.2041	1 290 000			1 290 000	1 629 915.00	0.07
1.75	CANTON OF ST. GALLEN 1.75%/13-18.07.2028	850 000			850 000	990 250.00	0.04
2	CANTON OF ST. GALLEN 2%/13-16.07.2038	600 000			600 000	770 100.00	0.03
1.25	CANTON OF ZÜRICH 1.25%/13-29.07.2022	250 000			250 000	273 000.00	0.01
1.625	CANTON OF ZÜRICH 1.625%/13-29.07.2026	2 030 000		2 000 000	30 000	34 530.00	0.00
2	CANTON OF ZÜRICH 2%/13-29.07.2038	3 250 000			3 250 000	4 161 625.00	0.18
1.25	EGW S. 43 1.25%/12-15.06.2027	2 250 000			2 250 000	2 490 750.00	0.11
0.875	EMISSIONST EGW S. 44 0.875%/12-24.03.2023	1 500 000		300 000	1 200 000	1 278 600.00	0.06
1.75	EMISSIONSZ EGW S. 42 1.75%/11-14.09.2026	750 000			750 000	873 375.00	0.04
0.375	EMISSIONSZENTRALE EGW S. -52- 0.375%/15-27.05.2030		3 000 000	600 000	2 400 000	2 361 600.00	0.10
2.25	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 25 2.25%/05-19.09.2017	850 000			850 000	897 600.00	0.04
2.375	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 27 2.375%/06-12.01.2018	250 000			250 000	266 750.00	0.01
1.375	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 45 1.375%/13-27.03.2028	1 090 000			1 090 000	1 225 160.00	0.05
1.125	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 50 1.125%/14-24.09.2029		400 000		400 000	437 000.00	0.02
0.625	EUROFIMA BASEL 0.625%/14-30.06.2021	1 000 000			1 000 000	1 038 000.00	0.04
2.125	EUROFIMA BASEL 2.125%/09-10.11.2017	900 000			900 000	949 500.00	0.04
2.25	EUROFIMA BASEL 2.25%/05-15.06.2016	4 105 000		4 105 000			
2.375	EUROFIMA BASEL 2.375%/05-03.08.2020	4 600 000			4 600 000	5 168 100.00	0.22
2.875	EUROFIMA BASEL 2.875%/05-04.02.2030	5 820 000		500 000	5 320 000	6 974 520.00	0.30
3	EUROFIMA BASEL 3%/06-15.05.2026	11 520 000		1 000 000	10 520 000	13 376 180.00	0.58
3	EUROFIMA BASEL 3%/07-22.05.2024	2 530 000			2 530 000	3 133 405.00	0.14
3.25	EUROFIMA BASEL 3.25%/03-28.12.2018	4 480 000			4 480 000	5 008 640.00	0.22
3.375	EUROFIMA BASEL 3.375%/04-29.12.2020	1 100 000			1 100 000	1 302 950.00	0.06
0.6	FREIBURGER KANTONALBANK 0.6%/15-09.04.2027		1 000 000		1 000 000	1 006 500.00	0.04
1.125	FREIBURGER KANTONALBANK 1.125%/12-01.02.2022	1 950 000			1 950 000	2 080 650.00	0.09
1.125	FREIBURGER KANTONALBANK 1.125%/13-28.03.2023	500 000		200 000	300 000	321 450.00	0.01
1.25	FREIBURGER KANTONALBANK 1.25%/14-03.06.2024	1 540 000			1 540 000	1 666 280.00	0.07
1.45	FREIBURGER KANTONALBANK 1.45%/12-07.06.2027	400 000			400 000	441 400.00	0.02
1.875	FREIBURGER KANTONALBANK 1.875%/10-17.02.2017	3 970 000			3 970 000	4 093 070.00	0.18
0.625	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.625%/15-20.04.2029		1 500 000		1 500 000	1 496 250.00	0.06
0.75	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.75%/14-07.05.2021	2 400 000			2 400 000	2 503 200.00	0.11
1.25	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 1.25%/12-14.06.2024	500 000			500 000	541 000.00	0.02
1.375	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 1.375%/13-11.03.2025	2 500 000			2 500 000	2 746 250.00	0.12
2	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 2%/10-08.02.2017	3 000 000			3 000 000	3 099 000.00	0.13
0.75	GRAUBUNDER KANTONALBANK 0.75%/12-14.06.2019	1 000 000			1 000 000	1 035 000.00	0.04
2	KANTON AARGAU 2%/10-15.12.2028	720 000			720 000	864 000.00	0.04
0.5	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.5%/14-30.03.2022	1 350 000		300 000	1 050 000	1 091 475.00	0.05
0.5	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.5%/15-23.02.2035	1 200 000			1 200 000	1 165 200.00	0.05
1	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1%/14-30.03.2027	2 000 000			2 000 000	2 148 000.00	0.09
1	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1%/15-05.03.2040		200 000		200 000	208 900.00	0.01
1.375	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1.375%/14-29.09.2034	3 500 000			3 500 000	3 948 000.00	0.17
1.5	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1.5%/13-26.06.2028	2 800 000			2 800 000	3 171 000.00	0.14
2.625	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 2.625%/11-10.05.2029	500 000			500 000	642 750.00	0.03
0.5	KANTON BASEL-STADT 0.5%/13-28.11.2018	2 000 000		1 450 000	550 000	565 125.00	0.02
1.875	KANTON BASEL-STADT 1.875%/10-31.05.2019	3 030 000			3 030 000	3 281 490.00	0.14
3.25	KANTON BASEL-STADT 3.25%/08-31.01.2020	4 150 000			4 150 000	4 795 325.00	0.21
1.75	KANTON BASELLANDSCHAFT 1.75%/13-26.06.2043	930 000			930 000	1 154 130.00	0.05
2.625	KANTON BASELLANDSCHAFT 2.625%/11-10.05.2030	500 000			500 000	650 500.00	0.03
0.625	KANTON BERN 0.625%/15-11.02.2032	1 200 000			1 200 000	1 227 600.00	0.05
1	KANTON BERN 1%/12-25.10.2024	1 600 000			1 600 000	1 719 200.00	0.07
1.25	KANTON BERN 1.25%/12-30.03.2027	500 000			500 000	550 250.00	0.02
1.25	KANTON BERN 1.25%/13-07.02.2028	2 000 000			2 000 000	2 201 000.00	0.10
1.25	KANTON BERN 1.25%/13-20.09.2021	1 600 000		200 000	1 400 000	1 517 600.00	0.07
1.25	KANTON BERN 1.25%/14-12.09.2030	1 000 000			1 000 000	1 102 000.00	0.05
1.25	KANTON BERN 1.25%/14-22.04.2024	1 200 000			1 200 000	1 315 800.00	0.06
1.5	KANTON BERN 1.5%/13-15.05.2029	2 450 000			2 450 000	3 126 750.00	0.14
1.75	KANTON BERN 1.75%/10-24.09.2025	2 750 000		2 250 000	200 000	230 400.00	0.01
2.25	KANTON BERN 2.25%/10-31.05.2023	6 375 000			6 375 000	7 458 750.00	0.32
2.25	KANTON BERN 2.25%/11-20.04.2026	1 500 000			1 500 000	1 815 750.00	0.08
2.375	KANTON BERN 2.375%/10-25.03.2022	2 300 000			2 300 000	2 670 300.00	0.12
2.5	KANTON BERN 2.5%/09-26.11.2021	500 000			500 000	581 000.00	0.03
2.625	KANTON BERN 2.625%/09-24.04.2020	780 000			780 000	883 740.00	0.04
3.125	KANTON BERN 3.125%/07-27.06.2019	880 000			880 000	997 040.00	0.04
0.25	KANTON GENF 0.25%/13-20.09.2016	500 000			500 000	503 800.00	0.02
1	KANTON GENF 1%/12-26.10.2022	1 000 000			1 000 000	1 069 500.00	0.05
1.25	KANTON GENF 1.25%/12-26.10.2026	3 160 000			3 160 000	3 468 100.00	0.15
1.25	KANTON GENF 1.25%/12-29.12.2022	1 100 000			1 100 000	1 199 550.00	0.05
1.5	KANTON GENF 1.5%/11-14.10.2024	5 050 000			5 050 000	5 645 900.00	0.24
1.5	KANTON GENF 1.5%/12-05.03.2032	2 450 000			2 450 000	2 757 475.00	0.12
1.5	KANTON GENF 1.5%/12-27.01.2028	1 000 000			1 000 000	1 121 000.00	0.05
1.5	KANTON GENF 1.5%/12-28.05.2027	1 350 000			1 350 000	1 517 400.00	0.07
1.625	KANTON GENF 1.625%/11-28.11.2023	4 950 000			4 950 000	5 561 325.00	0.24
1.75	KANTON GENF 1.75%/13-22.03.2033	500 000			500 000	585 000.00	0.03
1.75	KANTON GENF 1.75%/13-24.05.2034	1 000 000			1 000 000	1 175 000.00	0.05
2	KANTON GENF 2%/13-20.03.2026	3 200 000			3 200 000	3 764 800.00	0.16
2.125	KANTON GENF 2.125%/10-15.06.2020	3 500 000		300 000	3 200 000	3 553 600.00	0.15
2.125	KANTON GENF 2.125%/10-27.10.2028	1 820 000			1 820 000	2 192 190.00	0.09
2.25	KANTON GENF 2.25%/11-22.02.2021	1 600 000		200 000	1 400 000	1 582 000.00	0.07
2.25	KANTON GENF 2.25%/13-20.09.2029	3 150 000			3 150 000	3 860 325.00	0.17
2.5	KANTON GENF 2.5%/09-27.11.2019	950 000			950 000	1 061 625.00	0.05
2.5	KANTON GENF 2.5%/10-06.04.2022	2 700 000		200 000	2 500 000	2 922 500.00	0.13

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2	KANTON LUZERN 2%/13-28.10.2033	2 000 000			2 000 000	2 469 000.00	0.11
1	KANTON OF SOLOTHURN 1%/15-20.02.2045	2 000 000		300 000	1 700 000	1 807 100.00	0.08
1.25	KANTON OF ZUERICH 1.25%/14-07.03.2024	2 000 000			2 000 000	2 200 000.00	0.10
0.375	KANTON SOLOTHURN 0.375%/12-29.11.2019	750 000			750 000	771 000.00	0.03
1.125	KANTON SOLOTHURN 1.125%/12-29.11.2027	3 250 000			3 250 000	3 534 375.00	0.15
3.125	KANTON ST. GALLEN 3.125%/04-03.02.2020	1 355 000			1 355 000	1 559 605.00	0.07
3.75	KANTON ST. GALLEN 3.75%/98-09.04.2018	1 030 000			1 030 000	1 141 240.00	0.05
0.5	KANTON WAADT 0.5%/14-18.12.2024	4 000 000			4 000 000	4 116 000.00	0.18
1	KANTON WAADT 1%/12-07.06.2022		200 000		200 000	214 400.00	0.01
2	KANTON WAADT 2%/13-24.10.2033	2 400 000			2 400 000	2 962 800.00	0.13
0.375	KANTON ZUERICH 0.375%/14-06.10.2021	1 000 000		200 000	800 000	828 400.00	0.04
0.5	KANTON ZUERICH 0.5%/12-03.12.2020	1 800 000		300 000	1 500 000	1 560 750.00	0.07
1	KANTON ZUERICH 1%/12-03.12.2025	1 500 000		1 500 000			
1	KANTON ZUERICH 1%/14-06.10.2027	1 000 000			1 000 000	1 085 000.00	0.05
1.25	KANTON ZUERICH 1.25%/12-03.12.2032	1 420 000			1 420 000	1 571 940.00	0.07
2.75	KANTON ZUERICH 2.75%/04-24.11.2017	4 010 000			4 010 000	4 308 745.00	0.19
0.5	KANTON ZURICH 0.5%/13-06.06.2019	670 000			670 000	692 445.00	0.03
1.375	KANTON ZURICH 1.375%/13-06.12.2023	2 000 000			2 000 000	2 219 000.00	0.10
2.375	KRAFTWERK AMSTEG 2.375%/06-09.03.2018	500 000			500 000	528 500.00	0.02
2.375	LUZERNER KANTONALBANK 2.375%/09-10.09.2018	2 330 000		1 300 000	1 030 000	1 110 340.00	0.05
2.5	LUZERNER KANTONALBANK 2.5%/10-07.01.2022	2 600 000			2 600 000	2 997 800.00	0.13
1.125	LUZERNER KANTONALBANK 1.125%/14-30.06.2023	2 300 000			2 300 000	2 465 600.00	0.11
1.625	LUZERNER KANTONALBANK 1.625%/12-20.07.2037	1 350 000			1 350 000	1 563 975.00	0.07
1.875	LUZERNER KANTONALBANK 1.875%/10-26.11.2035	1 210 000			1 210 000	1 439 295.00	0.06
1.875	LUZERNER KANTONALBANK 1.875%/10-30.06.2020	2 800 000		300 000	2 500 000	2 736 250.00	0.12
2	LUZERNER KANTONALBANK 2%/10-27.12.2039	1 200 000			1 200 000	1 483 200.00	0.06
2.125	LUZERNER KANTONALBANK 2.125%/11-04.10.2041	1 260 000			1 260 000	1 605 240.00	0.07
2.5	LUZERNER KANTONALBANK 2.5%/11-11.03.2043	250 000			250 000	344 875.00	0.01
2.625	LUZERNER KANTONALBANK 2.625%/05-25.11.2020	4 090 000		300 000	3 790 000	4 316 810.00	0.19
2.75	LUZERNER KANTONALBANK 2.75%/06-15.11.2016	2 000 000			2 000 000	2 073 800.00	0.09
3	LUZERNER KANTONALBANK 3%/05-11.03.2025	2 190 000			2 190 000	2 733 120.00	0.12
3.375	LUZERNER KANTONALBANK 3.375%/07-05.07.2019	1 700 000			1 700 000	1 928 650.00	0.08
0.25	NOVARTIS 0.25%/15-13.05.2025	2 550 000		2 050 000	500 000	494 750.00	0.02
0.625	NOVARTIS 0.625%/15-13.11.2029	7 670 000	100 000	1 900 000	5 870 000	5 802 495.00	0.25
1.05	NOVARTIS 1.05%/15-11.05.2035	4 250 000	1 000 000	300 000	4 950 000	5 014 350.00	0.22
2.125	PFANDBRIEF SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE S. -613	1 100 000			1 100 000	1 361 800.00	0.06
0.25	PFANDBRIEFBANK DER SCHWEIZERISCHER KANTONALBANKEN	700 000			700 000	713 300.00	0.03
0.375	PFANDBRIEFBANK S. 577 0.375%/12-13.07.2018	7 410 000		4 470 000	2 940 000	3 005 856.00	0.13
1	PFANDBRIEFBANK S. 595 1%/14-21.03.2023	1 400 000			1 400 000	1 495 760.00	0.06
1.5	PFANDBRIEFBANK S. 602 1.5%/14-05.12.2040		500 000		500 000	573 750.00	0.02
0.625	PFANDBRIEFBANK S. 603 0.625%/14-19.03.2025	3 250 000			3 250 000	3 359 525.00	0.15
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -613	2 000 000			2 000 000	2 044 400.00	0.09
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -614	1 000 000			1 000 000	1 045 800.00	0.05
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -615	1 000 000			1 000 000	1 056 000.00	0.05
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 000 000			5 000 000	5 073 000.00	0.22
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 600 000			3 600 000	3 670 920.00	0.16
2	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 030 000					
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		2 500 000		2 500 000	2 456 250.00	0.11
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 000 000		300 000	6 700 000	7 289 600.00	0.32
1.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	500 000			500 000	571 550.00	0.02
3.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 910 000			7 910 000	9 789 416.00	0.42
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 070 000			8 070 000	8 705 916.00	0.38
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 250 000			5 250 000	5 625 375.00	0.24
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 500 000			2 500 000	2 567 250.00	0.11
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 250 000			3 250 000	4 066 725.00	0.18
2	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 000 000			3 000 000	3 274 200.00	0.14
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 700 000		900 000	6 800 000	7 796 200.00	0.34
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		600 000		600 000	790 620.00	0.03
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 500 000			2 500 000	2 767 250.00	0.12
1.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 000 000		300 000	4 700 000	5 154 960.00	0.22
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		500 000		500 000	533 300.00	0.02
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 800 000			6 800 000	7 765 600.00	0.34
3.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 950 000			5 950 000	6 567 015.00	0.28
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 100 000		300 000	3 800 000	4 052 700.00	0.18
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 850 000			5 850 000	6 942 195.00	0.30
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 500 000		300 000	3 200 000	3 576 000.00	0.15
0.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 000 000			1 000 000	1 013 500.00	0.04
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 500 000			2 500 000	2 801 000.00	0.12
2.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 500 000			3 500 000	4 414 900.00	0.19
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	9 000 000			9 000 000	10 422 900.00	0.45
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 700 000		2 700 000			
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	250 000			250 000	275 425.00	0.01
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 050 000			5 050 000	6 084 745.00	0.26
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 900 000			5 900 000	6 547 820.00	0.28
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 500 000			6 500 000	6 641 050.00	0.29
1.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 875 000			8 875 000	10 500 900.00	0.45
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 430 000			5 430 000	7 206 696.00	0.31
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 250 000		300 000	6 950 000	7 383 680.00	0.32
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 350 000			3 350 000	3 703 760.00	0.16
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 100 000			4 100 000	5 059 810.00	0.22
0.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 760 000		1 000 000	760 000	794 580.00	0.03
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 500 000			1 500 000	1 513 350.00	0.07
2.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 610 000		300 000	6 310 000	7 244 511.00	0.31
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	950 000	900 000		1 850 000	2 072 185.00	0.09
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 750 000			4 750 000	5 322 375.00	0.23
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 100 000			7 100 000	8 026 550.00	0.35
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 910 000		300 000	7 610 000	8 625 935.00	0.37
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 680 000		1 500 000	7 180 000	7 612 954.00	0.33
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		2 770 000		2 770 000	2 790 775.00	0.12
0.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 100 000			3 100 000	3 132 240.00	0.14
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		750 000		750 000	751 725.00	0.03
2.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 850 000			3 850 000	4 981 130.00	0.22

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	845 000			845 000	868 829.00	0.04
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 750 000			3 750 000	4 155 000.00	0.18
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 500 000			1 500 000	1 621 650.00	0.07
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 360 000		300 000	8 060 000	8 595 990.00	0.37
3	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 270 000			6 270 000	6 661 875.00	0.29
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 900 000			1 900 000	2 126 100.00	0.09
0.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 000 000			3 000 000	3 108 900.00	0.13
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 290 000		1 400 000	6 890 000	7 220 720.00	0.31
2.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 850 000			5 850 000	6 516 900.00	0.28
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 900 000			1 900 000	1 985 690.00	0.09
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 780 000			5 780 000	7 086 280.00	0.31
2.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 200 000			2 200 000	2 822 380.00	0.12
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	500 000			500 000	538 050.00	0.02
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 310 000			5 310 000	6 390 585.00	0.28
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	400 000	660 000		1 060 000	1 171 512.00	0.05
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 650 000		300 000	7 350 000	8 154 825.00	0.35
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	10 000 000		1 000 000	9 000 000	10 052 100.00	0.44
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 200 000		7 000 000	200 000	205 440.00	0.01
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 000 000		300 000	5 700 000	6 333 270.00	0.27
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 700 000		300 000	1 400 000	1 484 980.00	0.06
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 800 000		300 000	3 500 000	4 123 000.00	0.18
0.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		1 500 000	500 000	1 000 000	1 014 100.00	0.04
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 500 000			1 500 000	1 600 950.00	0.07
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 950 000		300 000	5 650 000	6 157 935.00	0.27
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 000 000			3 000 000	3 272 400.00	0.14
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	300 000			300 000	309 000.00	0.01
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		3 000 000	3 000 000			
2.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 405 000		200 000	6 205 000	7 378 365.50	0.32
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 450 000		3 450 000			
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANK	5 600 000			5 600 000	6 039 600.00	0.26
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANK	4 850 000		300 000	4 550 000	4 805 710.00	0.21
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 050 000		1 400 000	3 650 000	3 739 425.00	0.16
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	400 000			400 000	436 800.00	0.02
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 950 000		300 000	5 650 000	6 133 075.00	0.27
2.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 700 000			3 700 000	4 299 400.00	0.19
2.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 750 000			5 750 000	6 310 625.00	0.27
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 000 000		300 000	3 700 000	4 093 680.00	0.18
0.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		3 000 000		3 000 000	3 005 100.00	0.13
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 500 000			2 500 000	2 632 000.00	0.11
2	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 700 000			5 700 000	6 680 400.00	0.29
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 000 000			3 000 000	3 092 100.00	0.13
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 000 000		3 000 000			
2.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 080 000			7 080 000	8 262 360.00	0.36
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 750 000		300 000	5 450 000	5 902 350.00	0.26
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 200 000			1 200 000	1 307 520.00	0.06
1	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 750 000			4 750 000	5 072 525.00	0.22
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	8 000 000			8 000 000	8 852 800.00	0.38
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 200 000			5 200 000	5 873 400.00	0.25
2.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 920 000			3 920 000	4 315 920.00	0.19
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 280 000		200 000	4 080 000	4 512 480.00	0.20
3	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 250 000		1 000 000	5 250 000	5 693 625.00	0.25
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 250 000			1 250 000	1 408 875.00	0.06
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 700 000			3 700 000	3 895 730.00	0.17
0.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		2 500 000		2 500 000	2 562 500.00	0.11
3.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 400 000			6 400 000	7 100 800.00	0.31
2	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 350 000			7 350 000	7 787 325.00	0.34
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 000 000			5 000 000	5 155 000.00	0.22
2.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 245 000			5 245 000	5 438 016.00	0.24
3.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 000 000			1 000 000	1 073 500.00	0.05
3.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 120 000			7 120 000	8 134 600.00	0.35
0.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	500 000			500 000	506 800.00	0.02
0.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		3 800 000		3 800 000	3 889 300.00	0.17
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 785 000		250 000	2 535 000	2 636 400.00	0.11
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 000 000			2 000 000	2 123 400.00	0.09
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 800 000			4 400 000	4 999 280.00	0.22
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		1 500 000		1 500 000	1 469 850.00	0.06
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 670 000			2 670 000	2 954 355.00	0.13
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 700 000			5 700 000	6 548 160.00	0.28
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	400 000		400 000			
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 960 000			1 960 000	2 029 580.00	0.09
1	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 145 000		2 000 000	4 145 000	4 431 005.00	0.19
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 500 000		400 000	7 100 000	7 685 040.00	0.33
2.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 350 000			5 350 000	5 934 220.00	0.26
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 025 000			3 025 000	3 280 612.50	0.14
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 000 000			2 000 000	2 293 800.00	0.10
0.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 200 000		1 000 000	3 200 000	3 357 440.00	0.15
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 000 000			1 000 000	1 091 700.00	0.05
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 700 000		900 000	3 600 000	4 044 240.00	0.18
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 250 000			1 250 000	1 360 000.00	0.06
2.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 000 000			3 000 000	3 642 000.00	0.16
2.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 450 000			5 450 000	5 708 330.00	0.25
0.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 250 000			2 250 000	2 356 875.00	0.10
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 750 000			7 750 000	8 472 300.00	0.37
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE S. 428 0.875%/12-20.06.2022	8 000 000		200 000	7 800 000	8 271 900.00	0.36
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 429 1.375%/13-05.11.2027	4 700 000		700 000	5 400 000	5 972 940.00	0.26
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE S. 433 1.5%/13-21.06.2028	1 000 000			1 000 000	1 121 500.00	0.05
0.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 439 0.375%/13-31.10.2017	2 275 000			2 275 000	2 315 495.00	0.10
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 440 1.25%/13-29.10.2021	4 000 000		300 000	3 700 000	3 994 150.00	0.17
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 442 1.375%/13-12.12.2022	1 400 000			1 400 000	1 534 820.00	0.07
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 443 0.25%/14-28.03.2018	1 500 000		1 000 000	500 000	508 150.00	0.02
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE S. 445 1.625%/14-17.06.2026	6 000 000			6 000 000	6 805 200.00	0.29
1	PFANDBRIEFZENTRALE S. 452 1%/14-18.12.2023	3 000 000			3 000 000	3 209 400.00	0.14

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
0.5 PFANDBRIEFZENTRALE S. 458 0.5%/14-20.10.2023	4 000 000			4 000 000	4 116 400.00	0.18
1 PFANDBRIEFZENTRALE S. 459 1%/14-22.09.2028	3 000 000			3 000 000	3 178 500.00	0.14
0.375 PFANDBRIEFZENTRALE S.461 0.375%/15-14.02.2025		2 000 000		2 000 000	2 024 000.00	0.09
0.25 PFANDBRIEFZENTRALE s 446 0.25%/14-21.06.2018	2 100 000		1 400 000	700 000	712 600.00	0.03
0.875 PFANDBRIEFZENTRALE s 447 0.875%/14-10.06.2021	2 850 000			2 850 000	3 004 470.00	0.13
1.375 RAIFFEISEN SCHWEIZ 1.375%/10-21.09.2017	1 550 000		1 550 000			
1.625 RAIFFEISEN SCHWEIZ 1.625%/14-07.02.2022	250 000		250 000			
2 RAIFFEISEN SCHWEIZ 2%/10-21.09.2023	1 950 000		1 950 000			
2.125 RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.125%/11-04.02.2019	3 450 000		3 450 000			
2.375 RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.375%/11-10.05.2018	900 000		900 000			
3.125 RAIFFEISEN SCHWEIZ 3.125%/06-30.05.2016	5 260 000		5 260 000			
0.25 SCHAFFHAUSER KANTONALBANK 0.25%/13-28.10.2016	500 000			500 000	503 450.00	0.02
1.75 SCHAFFHAUSER KB 1.75%/13-28.10.2025	800 000			800 000	906 400.00	0.04
0.75 SCHWYZER KANTONALBANK 0.75%/1-12.03.2020	1 000 000			1 000 000	1 038 500.00	0.04
1.125 SCHWYZER KANTONALBANK 1.125%/13-20.02.2023	450 000			450 000	482 400.00	0.02
1.375 SCHWYZER KANTONALBANK 1.375%/13-24.09.2021	2 400 000			2 400 000	2 593 200.00	0.11
1.625 SCHWYZER KANTONALBANK 1.625%/10-25.05.2016	2 100 000		2 100 000			
0.625 ST. GALLER KANTONALBANK 0.625%/14-09.09.2022	1 000 000			1 000 000	1 033 500.00	0.04
1.5 ST. GALLER KANTONALBANK 1.5%/13-13.09.2022	1 750 000			1 750 000	1 915 375.00	0.08
2.5 ST. GALLER KANTONALBANK 2.5%/05-30.11.2017	4 370 000			4 370 000	4 640 940.00	0.20
2.25 ST.GALLER KANTONALBANK 2.25%/10-11.05.2020	1 350 000			1 350 000	1 499 850.00	0.06
2.5 ST.GALLER KANTONALBANK 2.5%/06-12.12.2018	3 315 000			3 315 000	3 611 692.50	0.16
1.375 ST.GALLER KANTONALBANK 1.375%/12-22.06.2027	1 400 000			1 400 000	1 530 200.00	0.07
1.5 ST.GALLER KANTONALBANK 1.5%/13-12.02.2031	500 000			500 000	555 500.00	0.02
2.75 ST.GALLER KANTONALBANK 2.75%/04-20.12.2016	1 885 000			1 885 000	1 960 400.00	0.08
3.5 ST.GALLER KANTONALBANK 3.5%/07-27.07.2017	1 800 000			1 800 000	1 929 600.00	0.08
1.625 STADT BERN 1.625%/11-01.11.2024	700 000			700 000	784 350.00	0.03
2.125 STADT BERN 2.125%/13-11.10.2038	1 000 000			1 000 000	1 266 500.00	0.05
2.5 STADT BERN 2.5%/05-26.09.2025	850 000			850 000	1 029 775.00	0.04
2.5 STADT BERN 2.5%/10-01.04.2025	750 000			750 000	907 500.00	0.04
2.5 STADT BERN 2.5%/11-01.04.2041	3 140 000			3 140 000	4 265 690.00	0.18
3 STADT BERN 3%/08-31.03.2016	4 870 000		4 870 000			
1.375 STADT GENEVA 1.375%/12-19.11.2029	5 200 000			5 200 000	5 816 200.00	0.25
1.625 STADT STGALLEN 1.625%/11-10.11.2025	300 000			300 000	340 650.00	0.01
1.5 STADT WINTERTHUR 1.5%/14-06.06.2029	1 000 000			1 000 000	1 114 000.00	0.05
1.875 STADT WINTERTHUR 1.875%/12-20.04.2037	2 500 000			2 500 000	3 010 000.00	0.13
2.25 STADT WINTERTHUR 2.25%/14-10.02.2039	1 900 000			1 900 000	2 434 850.00	0.11
2.375 STADT WINTERTHUR 2.375%/06-15.02.2018	500 000			500 000	531 750.00	0.02
0.25 STADT ZUERICH 0.25%/14-21.08.2019	1 610 000			1 610 000	1 640 590.00	0.07
1 STADT ZUERICH 1%/12-05.12.2023	2 500 000			2 500 000	2 676 250.00	0.12
1 STADT ZUERICH 1%/14-25.04.2022	1 435 000			1 435 000	1 534 732.50	0.07
1 STADT ZUERICH 1%/14-30.03.2027	900 000			900 000	955 800.00	0.04
1.125 STADT ZUERICH 1.125%/14-06.03.2023	1 000 000			1 000 000	1 078 000.00	0.05
1.125 STADT ZUERICH 1.125%/15-26.06.2040		1 000 000		1 000 000	1 061 000.00	0.05
1.5 STADT ZUERICH 1.5%/12-12.04.2032	850 000			850 000	959 650.00	0.04
1.75 STADT ZUERICH 1.75%/14-06.03.2029	1 750 000			1 750 000	2 024 750.00	0.09
2 STADT ZUERICH 2%/13-18.12.2043	600 000			600 000	767 100.00	0.03
2.125 STADT ZUERICH 2.125%/05-12.08.2016	6 380 000		5 200 000	1 180 000	1 208 320.00	0.05
2.125 STADT ZUERICH 2.125%/10-10.06.2020	950 000			950 000	1 054 025.00	0.05
2.125 STADT ZUERICH 2.125%/13-26.09.2033	300 000			300 000	372 600.00	0.02
2.375 STADT ZUERICH 2.375%/09-10.09.2018	2 000 000		2 000 000			
2.375 STADT ZUERICH 2.375%/11-21.02.2024	700 000			700 000	830 550.00	0.04
2.55 STADT ZUERICH 2.55%/06-10.03.2036	6 240 000		200 000	6 040 000	8 072 460.00	0.35
2.625 STADT ZUERICH 2.625%/11-10.06.2038	1 500 000			1 500 000	2 068 500.00	0.09
2.75 STADT ZUERICH 2.75%/05-14.02.2025	1 750 000			1 750 000	2 158 625.00	0.09
2.75 STADT ZUERICH 2.75%/09-20.02.2019	2 320 000			2 320 000	2 565 920.00	0.11
2.875 STADT ZUERICH 2.875%/09-21.04.2021	2 500 000			2 500 000	2 917 500.00	0.13
3 STADT ZUERICH 3%/07-08.06.2022	4 130 000			4 130 000	4 970 455.00	0.22
3.5 STADT ZUERICH 3.5%/08-14.08.2020	2 500 000		300 000	2 200 000	2 604 800.00	0.11
0.5 SWISS CONFEDERATION 0.5%/15-27.05.2030		1 300 000		1 300 000	1 356 940.00	0.06
1.25 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-11.06.2024	21 370 000		200 000	21 170 000	23 958 089.00	1.04
1.25 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-27.06.2037	23 480 000	2 000 000	2 800 000	22 680 000	26 490 240.00	1.15
1.25 SWISS CONFEDERATION 1.25%/14-28.05.2026	7 880 000	1 000 000		8 880 000	10 125 864.00	0.44
1.5 SWISS CONFEDERATION 1.5%/12-30.04.2042	24 700 000	300 000	1 350 000	23 650 000	29 337 825.00	1.27
1.5 SWISS CONFEDERATION 1.5%/13-24.07.2025	11 720 000	1 000 000		12 720 000	14 774 280.00	0.64
2 SWISS CONFEDERATION 2%/05-12.10.2016	23 700 000	2 000 000	23 700 000	2 000 000	2 061 000.00	0.09
2 SWISS CONFEDERATION 2%/10-28.04.2021	30 560 000	900 000	700 000	30 760 000	35 177 136.00	1.52
2 SWISS CONFEDERATION 2%/11-25.05.2022	25 550 000		300 000	25 250 000	29 350 600.00	1.27
2 SWISS CONFEDERATION 2%/14-25.06.2064	12 350 000	1 000 000	400 000	12 950 000	19 522 125.00	0.85
2.25 SWISS CONFEDERATION 2.25%/05-06.07.2020	34 255 000		4 400 000	29 855 000	34 061 569.50	1.48
2.25 SWISS CONFEDERATION 2.25%/11-22.06.2031	13 280 000			13 280 000	17 416 720.00	0.75
2.5 SWISS CONFEDERATION 2.5%/06-08.03.2036	25 009 000		3 700 000	21 309 000	29 971 108.50	1.30
3 SWISS CONFEDERATION 3%/03-08.01.2018	49 662 000	730 000		50 392 000	54 876 888.00	2.38
3 SWISS CONFEDERATION 3%/04-12.05.2019	43 010 000		200 000	42 810 000	48 760 590.00	2.11
3.25 SWISS CONFEDERATION 3.25%/07-27.06.2027	14 989 000	740 000	800 000	14 929 000	20 587 091.00	0.89
3.5 SWISS CONFEDERATION 3.5%/03-08.04.2033	25 945 000	100 000	2 400 000	23 645 000	36 439 309.50	1.58
4 SWISS CONFEDERATION 4%/98-08.04.2028	40 145 000		1 850 000	38 295 000	57 017 425.50	2.47
4 SWISS CONFEDERATION 4%/98-11.02.2023	32 369 000		300 000	32 069 000	42 513 873.30	1.84
4 SWISS CONFEDERATION 4%/99-06.01.2049	10 880 000		300 000	10 580 000	21 234 060.00	0.92
4.25 SWISS CONFEDERATION 4.25%/97-05.06.2017	40 612 000		5 000 000	35 612 000	38 763 662.00	1.68
0.4 SWISS CREDIT CARD ISSUANCE -A- 0.4%/13-15.06.2016	1 775 000		1 775 000			
0.625 SWISSGRID 0.625%/15-25.02.2030	850 000	650 000		1 500 000	1 452 750.00	0.06
1 SWISSGRID 1%/13-30.01.2020	250 000			250 000	260 250.00	0.01
1.625 SWISSGRID 1.625%/13-30.01.2025	1 620 000	750 000		2 370 000	2 621 220.00	0.11
0.375 THURGAUER KANTONALBANK 0.375%/15-31.03.2025		1 000 000		1 000 000	998 500.00	0.04
0.5 THURGAUER KANTONALBANK 0.5%/15-16.02.2029	1 100 000			1 100 000	1 073 600.00	0.05
1 THURGAUER KANTONALBANK 1%/12-30.11.2022	1 500 000			1 500 000	1 592 250.00	0.07
1.25 THURGAUER KANTONALBANK 1.25%/10-15.09.2017	750 000			750 000	773 250.00	0.03
1.375 THURGAUER KANTONALBANK 1.375%/14-28.08.2023	1 400 000			1 400 000	1 535 100.00	0.07
1.5 THURGAUER KANTONALBANK 1.5%/13-04.03.2027	2 380 000			2 380 000	2 631 090.00	0.11
1.75 THURGAUER KANTONALBANK 1.75%/13-30.09.2024	1 800 000			1 800 000	2 028 600.00	0.09
2.25 THURGAUER KANTONALBANK 2.25%/11-25.02.2021	2 300 000			2 300 000	2 584 050.00	0.11

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
3 THURGAUER KANTONALBANK 3%/08-29.01.2016	150 000		150 000			
0.9 TRANSPORTS PUBLICS GENEVOIS 0.9%/15-21.05.2035		500 000		500 000	481 000.00	0.02
0.4 WALLISER KANTONALBANK 0.4%/15-15.09.2025		3 000 000		3 000 000	2 978 700.00	0.13
2.375 WALLISER KANTONALBANK 2.375%/11-18.05.2021	1 400 000			1 400 000	1 579 900.00	0.07
1.25 ZUERCHER KANTONALBANK 1.25%/12-31.01.2022	750 000			750 000	807 000.00	0.03
2.125 ZUERCHER KANTONALBANK S. 109 2.125%/10-05.02.2018	3 100 000		1 000 000	2 100 000	2 222 850.00	0.10
1.625 ZUERCHER KANTONALBANK S. 110 1.625%/10-03.03.2016	3 000 000		3 000 000			
2.125 ZUERCHER KANTONALBANK S. 111 2.125%/10-12.03.2020	4 100 000		200 000	3 900 000	4 297 800.00	0.19
2.125 ZUERCHER KANTONALBANK S. 113 2.125%/10-29.06.2022	10 200 000		200 000	10 000 000	11 390 000.00	0.49
2 ZUERCHER KANTONALBANK S. 114 2%/10-08.09.2025	5 150 000			5 150 000	5 958 550.00	0.26
2 ZUERCHER KANTONALBANK S. 115 2%/10-30.11.2034	4 920 000			4 920 000	5 928 600.00	0.26
2 ZUERCHER KANTONALBANK S. 117 2%/11-21.01.2021	4 600 000		300 000	4 300 000	4 785 900.00	0.21
1.75 ZUERCHER KANTONALBANK S. 118 1.75%/11-29.03.2017	500 000			500 000	516 000.00	0.02
2.375 ZUERCHER KANTONALBANK S. 119 2.375%/11-29.03.2023	1 000 000			1 000 000	1 166 000.00	0.05
0.875 ZUERCHER KANTONALBANK S. 130 0.875%/13-17.05.2021	850 000			850 000	891 650.00	0.04
0.25 ZUERCHER KANTONALBANK S. 134 0.25%/15-31.03.2021		1 450 000	300 000	1 150 000	1 168 975.00	0.05
1 ZUERCHER KANTONALBANK S.123 1%/11-14.12.2018	1 190 000		1 190 000			
0.5 ZUGER KANTONALBANK 0.5%/15-03.03.2027	1 500 000			1 500 000	1 491 750.00	0.06
0.625 ZUGER KANTONALBANK 0.625%/14-17.10.2022	1 500 000			1 500 000	1 553 250.00	0.07
1 ZUGER KANTONALBANK 1%/12-26.09.2022	250 000			250 000	265 375.00	0.01
1.125 ZUGER KANTONALBANK 1.125%/13-29.10.2020	1 000 000		200 000	800 000	847 600.00	0.04
1.5 ZUGER KANTONALBANK 1.5%/11-27.09.2021	2 630 000			2 630 000	2 870 645.00	0.12
1.5 ZUGER KANTONALBANK 1.5%/11-28.11.2023	1 650 000			1 650 000	1 819 950.00	0.08
1.65 ZUGER KANTONALBANK 1.65%/13-02.04.2038	3 580 000			3 580 000	4 125 950.00	0.18
1.75 ZUGER KANTONALBANK 1.75%/10-03.12.2019	1 500 000			1 500 000	1 620 000.00	0.07
1.875 ZUGER KANTONALBANK 1.875%/10-14.10.2020	1 050 000			1 050 000	1 152 900.00	0.05
2.125 ZUGER KANTONALBANK 2.125%/09-22.12.2017	1 800 000			1 800 000	1 898 100.00	0.08
2.375 ZUGER KANTONALBANK 2.375%/11-25.05.2021	2 100 000		200 000	1 900 000	2 154 600.00	0.09
3.125 ZURICH 3.125%/08-27.03.2017	900 000			900 000	949 050.00	0.04
					1 683 756 814.80	72.92
Südkorea						
1.5 KEPCO 1.5%/13-23.04.2019	940 000			940 000	975 250.00	0.04
					975 250.00	0.04
USA						
0.375 APPLE 0.375%/15-25.11.2024	5 000 000	1 000 000	2 200 000	3 800 000	3 820 900.00	0.17
0.75 APPLE 0.75%/15-25.02.2030	6 500 000	1 000 000	500 000	7 000 000	7 031 500.00	0.30
5.5 IBRD 5.5%/86-05.02.2016	320 000		320 000			
2.75 INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMEN	270 000			270 000	303 750.00	0.01
0.75 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.75%/14-1704.201	2 500 000		1 150 000	1 350 000	1 386 450.00	0.06
1 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 1%/14-19.09.2022	2 400 000			2 400 000	2 500 800.00	0.11
1.125 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 1.125%/13-18.06	2 000 000		300 000	1 700 000	1 781 600.00	0.08
3.125 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 3.125%/06-27.06	1 200 000		1 200 000			
2.625 NESTLE HOLDINGS 2.625%/07-14.02.2018	2 390 000			2 390 000	2 566 860.00	0.11
0.375 NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.375%/15-02.02.2022		800 000		800 000	810 400.00	0.04
0.5 NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.5%/14-13.05.2019	1 500 000			1 500 000	1 520 250.00	0.07
					21 722 510.00	0.94
Venezuela						
0.45 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/15-07.09.2023		1 500 000		1 500 000	1 498 350.00	0.06
1.375 CORPORATION ANDINA DE FOMENTO 1.375%/13-11.02.2021	2 950 000			2 950 000	3 156 500.00	0.14
					4 654 850.00	0.20
Vereinigtes Königreich						
2.125 ANZ NATIONAL INTERNATIONAL LIMITED 2.125%/11-25.02	450 000		450 000			
0.875 ANZ NEW ZEALAND 0.875%/13-14.02.2019	2 000 000		2 000 000			
1 ANZ NEW ZEALAND 1%/14-10.03.2020	1 450 000			1 450 000	1 508 725.00	0.07
1.5 ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 1.5%/12-27.02.2018	780 000			780 000	816 270.00	0.04
1.125 ASB FINANCE 1.125%/14-05.02.2020	1 300 000			1 300 000	1 361 100.00	0.06
0.875 ASB FINANCE LONDON 0.875%/13-11.06.2019	2 000 000			2 000 000	2 069 000.00	0.09
2.125 ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH 2.125%/10-17.11.2016	1 870 000			1 870 000	1 918 433.00	0.08
1.375 ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH S. 2 1.375%/12-02.11	660 000			660 000	692 010.00	0.03
1.125 BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.125%/12-20.09.2019	1 500 000	500 000		2 000 000	2 086 000.00	0.09
1.375 BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.375%/14-03.02.2021	2 350 000			2 350 000	2 502 750.00	0.11
2.75 BRADFORD & BINGLEY 2.75%/06-16.10.2018	860 000			860 000	937 400.00	0.04
1.875 HSBC BANK 1.875%/10-01.09.2016	3 280 000		3 000 000	280 000	286 328.00	0.01
2.375 HSBC BANK 2.375%/11-04.04.2018	2 000 000		400 000	1 600 000	1 702 400.00	0.07
2.75 HSBC BANK 2.75%/07-03.04.2017	10 740 000		3 500 000	7 240 000	7 583 900.00	0.33
2.75 NETWORK RAIL INFRASTRUCTURE FINANCE 2.75%/06-06.10	4 210 000		300 000	3 910 000	4 604 025.00	0.20
0.625 WESTPAC SECURITIES NZ - LONDON BRANCH 0.625%/14-02		500 000		500 000	513 000.00	0.02
					28 581 341.00	1.24
Total Obligationen					2 287 684 137.30	99.07
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					2 287 684 137.30	99.07
Total Anlagen					2 287 684 137.30	99.07
Bankguthaben auf Sicht					755 325.31	0.03
Sonstige Vermögenswerte					20 755 912.83	0.90
Gesamtfondsvermögen (GFV)					2 309 195 375.44	100.00
./. Andere Verbindlichkeiten					18 030.28	0.00
Nettofondsvermögen					2 309 177 345.16	100.00

¹ Umfassen Käufe und Verkäufe sowie Corporate Actions

Gemäss § 18 des Fondsreglements wurden in der Berichtsperiode folgende Anteile gegen Effekten statt in bar ausgegeben bzw. zurückgenommen:

Klasse	Datum	Anteile	Währung	NAV	Ausgabe	Rücknahme
Z	20.05.2015	5 760	CHF	1 129.13	x	
D	09.06.2015	24 950	CHF	1 029.02		x
D	21.07.2015	35 658.647	CHF	1 039.83		x

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. März 2015 bis zum 31. August 2015

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen- Währung	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	In % des GFV
08.04.2015	Kauf	CHF	110 643.96	EUR	106 225.00		
Total Devisentermingeschäfte						0.00	0.00

Kurze Übersicht

Kennzahlen		31.08.2015	28.02.2015	28.02.2014
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	6 405.6	6 205.7	5 166.8
Anteilklasse D				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	624.8	635.5	703.7
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 138.86	1 157.84	1 108.94
Anteilklasse F				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	39.1	29.4	20.4
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 106.94	1 125.02	1 077.59
Anteilklasse Z				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	5 741.7	5 540.9	4 442.7
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 134.64	1 153.98	1 105.30

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.08.2015
EURO	1.083600
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000

**Vermögens-
rechnung per
31. August 2015**

	Konsolidierung	
	31.08.2015	28.02.2015
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
– Sichtguthaben	2 640 138.93	3 999 239.70
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	6 342 998 356.20	6 133 873 974.60
Sonstige Vermögenswerte	59 994 684.00	67 882 161.32
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	6 405 633 179.13	6 205 755 375.62
Andere Verbindlichkeiten	50 742.86	44 464.66
Bankverbindlichkeiten	0.91	1.58
Nettofondsvermögen	6 405 582 435.36	6 205 710 909.38
Anzahl Anteile im Umlauf	5 644 303.446	5 376 488.795

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015	01.03.2014– 28.02.2015
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	6 205 710 909.38	5 166 786 302.18
Ordentliche Jahresausschüttung / Ablieferung VST	–128 204 065.82	–114 728 768.91
Ausgaben von Anteilen	625 019 994.51	1 316 973 227.51
Rücknahmen von Anteilen	–316 635 884.80	–522 537 344.22
Sonstiges aus Anteilverkehr	8 658 306.72	–25 753 948.86
Gesamterfolg	11 033 175.37	384 971 441.68
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	6 405 582 435.36	6 205 710 909.38
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	5 376 488.795	4 672 939.255
Ausgegebene Anteile	547 015.951	1 169 811.478
Zurückgenommene Anteile	–279 201.300	–466 261.938
Bestand am Ende der Berichtsperiode	5 644 303.446	5 376 488.795

Inventarwert pro Anteil
Ausserbilanzgeschäfte

Keine

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
635 484 098.30	703 671 215.40	29 364 971.16	20 398 798.71	5 540 861 839.92	4 442 716 288.07
–11 877 727.85	–13 759 409.22	–599 630.18	–392 065.31	–115 726 707.79	–100 577 294.38
75 798 105.62	118 485 207.89	13 046 154.78	13 075 726.20	536 175 734.11	1 185 412 293.42
–76 973 485.20	–214 130 057.31	–2 804 550.95	–5 073 405.70	–236 857 848.65	–303 333 881.21
1 584 215.25	2 260 937.62	22 108.77	–446 793.67	7 051 982.70	–27 568 092.81
788 595.44	38 956 203.92	62 962.54	1 802 710.93	10 181 617.39	344 212 526.83
624 803 801.56	635 484 098.30	39 092 016.12	29 364 971.16	5 741 686 617.68	5 540 861 839.92
548 852.446	634 543.644	26 101.740	18 929.947	4 801 534.609	4 019 465.664
67 009.120	105 758.976	11 744.260	11 779.118	468 262.571	1 052 273.384
–67 239.962	–191 450.174	–2 530.694	–4 607.325	–209 430.644	–270 204.439
548 621.604	548 852.446	35 315.306	26 101.740	5 060 366.536	4 801 534.609
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
1 138.86	1 157.84	1 106.94	1 125.02	1 134.64	1 153.98

**Erfolgsrechnung
für die Zeit vom
1. März 2015 bis
zum 31. August
2015**

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	0.00	13 700.08
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige		
Forderungswertpapiere und -rechte	59 863 376.80	114 494 794.74
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	2 500 631.80	15 288 996.00
Total Erträge abzüglich	62 364 008.60	129 797 490.82
 Passivzinsen	 0.11	 0.00
Negativzinsen	44 351.08	0.00
 Reglementarische Vergütung an:		
– die Fondsleitung	292 245.95	570 366.39
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	1 644 405.93	4 294 019.83
 Nettoertrag	 60 383 005.53	 124 933 104.60
 Realisierte Kapitalgewinne	 6 439 470.26	 15 950 781.49
Realisierte Kapitalverluste	–13 672 598.23	–22 461 187.35
Realisierter Erfolg	53 149 877.56	118 422 698.74
 Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	 –42 116 702.19	 266 548 742.94
Gesamterfolg	11 033 175.37	384 971 441.68

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
0.00	1 628.88	0.00	51.13	0.00	12 020.07
5 938 307.05	13 396 235.32	312 727.74	443 984.84	53 612 342.01	100 654 574.58
363 089.01	1 101 535.84	80 441.47	191 537.82	2 057 101.32	13 995 922.34
6 301 396.06	14 499 400.04	393 169.21	635 573.79	55 669 443.33	114 662 516.99
0.00	3.42	0.00	–0.25	0.11	–3.17
4 353.29	0.00	252.91	0.00	39 744.88	0.00
267 105.39	538 289.29	25 140.56	32 077.10	0.00	0.00
395 266.03	1 653 495.87	21 991.55	51 450.88	1 227 148.35	2 589 073.08
5 634 671.35	12 307 611.46	345 784.19	552 046.06	54 402 549.99	112 073 447.08
679 932.93	1 929 542.59	35 641.18	67 174.62	5 723 896.15	13 954 064.28
–1 384 552.11	–2 596 383.55	–80 020.74	–97 989.21	–12 208 025.38	–19 766 814.59
4 930 052.17	11 640 770.50	301 404.63	521 231.47	47 918 420.76	106 260 696.77
–4 141 456.73	27 315 433.42	–238 442.09	1 281 479.46	–37 736 803.37	237 951 830.06
788 595.44	38 956 203.92	62 962.54	1 802 710.93	10 181 617.39	344 212 526.83

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Obligationen							
Australien							
2.125	AMCOR 2.125%/12-04.04.2018	280 000	100 000		380 000	399 190.00	0.01
1.5	ANZ BANKING GROUP 1.5%/12-13.02.2019	500 000			500 000	530 000.00	0.01
2	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2%/10-08.07.	3 900 000	200 000	200 000	3 900 000	3 985 800.00	0.06
2.625	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2.625%/11-27	3 430 000			3 430 000	3 640 945.00	0.06
1.125	BENDIGO & ADEL 1.125%/14-25.03.2019	3 500 000		740 000	2 760 000	2 856 600.00	0.04
2.25	BORAL 2.25%/13-20.02.2020	500 000			500 000	526 500.00	0.01
1.5	COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA 1.5%/12-13.09.2019	3 250 000	1 700 000	500 000	4 450 000	4 750 375.00	0.07
0.875	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875%/13-11.02.202	3 700 000			3 700 000	3 844 300.00	0.06
1	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1%/13-25.09.2018	5 600 000			5 600 000	5 773 600.00	0.09
1.5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.5%/14-07.02.2022	4 600 000			4 600 000	4 981 800.00	0.08
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3%/09-09.11.2017	9 730 000			9 730 000	10 367 315.00	0.16
1	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA 1%/14-17.12.	500 000			500 000	502 250.00	0.01
0.625	MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023	3 000 000			3 000 000	2 989 500.00	0.05
2.125	MACQUARIE BANK 2.125%/12-29.11.2018	2 675 000		90 000	2 585 000	2 745 270.00	0.04
3	MACQUARIE BANK 3%/12-09.08.2017	5 260 000	750 000		6 010 000	6 349 565.00	0.10
3	MACQUARIE BANK 3%/12-29.11.2022	1 600 000		90 000	1 510 000	1 754 620.00	0.03
0.35	NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.35%/15-05.08.2022		3 010 000		3 010 000	3 008 495.00	0.05
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/13-17.04.2020	6 020 000			6 020 000	6 293 910.00	0.10
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/14-10.12.2021	3 900 000	250 000		4 150 000	4 372 025.00	0.07
1.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.125%/12-07.11.2018	1 450 000			1 450 000	1 501 475.00	0.02
1.5	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.5%/14-07.02.2024	5 000 000	100 000		5 100 000	5 689 050.00	0.09
1.625	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.625%/13-05.09.2023	4 270 000		110 000	4 160 000	4 582 240.00	0.07
2.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.125%/11-03.02.2017	2 000 000			2 000 000	2 062 000.00	0.03
2.25	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.25%/10-14.07.2017	8 960 000			8 960 000	9 345 280.00	0.15
2.25	SPI AUSTRALIA ASSETS 2.5%/10-09.08.2016	1 000 000			1 000 000	1 020 100.00	0.02
1.125	SPI ELECTRICITY & GAS 1.125%/12-18.04.2019	750 000			750 000	776 250.00	0.01
1.5	SPI ELECTRICITY & GAS 1.5%/12-21.02.2017	3 150 000			3 150 000	3 219 300.00	0.05
2.375	SPI ELECTRICITY & GAS AUSTRALIA HOLDINGS 2.625%/10	3 610 000	170 000	3 780 000			
1.75	TELSTRA 1.75%/11-14.12.2018	400 000			400 000	422 000.00	0.01
0.4	WESTPAC BANKING 0.40%/15-09.06.2023		1 000 000		1 000 000	1 002 000.00	0.02
0.5	WESTPAC BANKING 0.5%/15-02.02.2022	2 600 000			2 600 000	2 652 000.00	0.04
2	WESTPAC BANKING 2%/11-15.12.2016	200 000			200 000	205 280.00	0.00
2.5	WESTPAC BANKING 2.5%/10-16.02.2017	920 000			920 000	954 040.00	0.01
3.125	WESTPAC BANKING 3.125%/09-21.12.2018	5 360 000	200 000		5 560 000	6 127 120.00	0.10
						109 230 195.00	1.71
Bermudas							
3	CBO FINANCE 3%/10-07.12.2015	4 740 000		4 740 000			
3.375	HOLCIM OVERSEAS FINANCE 3.375%/11-10.06.2021	6 060 000	750 000		6 810 000	7 971 105.00	0.12
						7 971 105.00	0.12
Brasilien							
2.75	BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONOMICO E SOCI	1 210 000	300 000		1 510 000	1 525 855.00	0.02
						1 525 855.00	0.02
Britische Jungferninseln							
0.76	SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL 0.76%/15-17.06.2022		2 500 000		2 500 000	2 490 000.00	0.04
						2 490 000.00	0.04
Cayman-Inseln							
3	ABU DHABI COMMERCIAL BANK 3%/11-08.12.2015	510 000		510 000			
2.5	BANCO DO BRASIL CAYMAN 2.5%/13-20.06.2019	3 740 000	5 000 000		8 740 000	8 718 150.00	0.14
1.5	BANCO SAFRA 1.5%/14-11.12.2019	500 000			500 000	497 500.00	0.01
1.85	BANCO SAFRA 1.85%/14-27.06.2017	3 750 000			3 750 000	3 789 375.00	0.06
3.25	BANCO SANTANDER BRAZIL S.A. GRAND CAYMAN BRANCH 3.	1 000 000	1 650 000		2 650 000	2 688 690.00	0.04
2.75	GIC FUNDING 2.75%/12-16.11.2015	800 000	200 000	1 000 000			
2.125	LGT FINANCE 2.125%/11-25.11.2015	1 295 000		1 295 000			
2.5	LGT FINANCE 2.5%/10-12.05.2017	4 670 000			4 670 000	4 866 140.00	0.08
2.75	LGT FINANCE 2.75%/09-08.12.2016	2 430 000		150 000	2 280 000	2 362 080.00	0.04
2.375	NEW YORK LIFE FUNDING 2.375%/06-22.02.2016	3 470 000		3 470 000			
3.125	PRINCIPAL FINANCIAL GLOBAL FUNDING 3.125%/06-29.06	140 000			140 000	143 598.00	0.00
0.5	QNB FINANCE LTD 0.5%/13-27.06.2016	2 190 000			2 190 000	2 195 694.00	0.03
						25 261 227.00	0.39
Chile							
1.375	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1.375%/14-09.05.20	500 000			500 000	501 000.00	0.01
0.25	BANCO DE CHILE 0.25%/15-17.06.2020		3 000 000		3 000 000	2 985 000.00	0.05
1.25	BANCO DE CHILE 1.25%/14-21.03.2019	1 500 000	50 000		1 550 000	1 591 075.00	0.02
1.5	BANCO DE CHILE 1.5%/13-03.12.2019	1 500 000			1 500 000	1 574 250.00	0.02
0.875	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 0.875%/14-23.11.2	1 700 000			1 700 000	1 733 150.00	0.03
1.125	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 1.125%/14-26.06.2	2 500 000			2 500 000	2 565 000.00	0.04
1.25	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 1.25%/13-26.09.20	2 000 000			2 000 000	2 022 800.00	0.03
1	BANCO SANTANDER CHILE 1%/14-31.07.2017	3 000 000			3 000 000	3 045 000.00	0.05
2.25	BANCO SANTANDER CHILE 2.25%/10-16.12.2015	600 000		600 000			
1.125	CHILE 1.125%/13-23.05.2018	2 400 000	50 000		2 450 000	2 506 350.00	0.04
1.125	CHILE 1.125%/13-25.07.2017	2 450 000			2 450 000	2 496 550.00	0.04
2.875	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO 2.875%/13-05.12.2018		1 000 000	100 000	900 000	942 750.00	0.01
						21 962 925.00	0.34
Curacao							
1.5	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.5%/12-25.10.2018	5 720 000	250 000		5 970 000	6 175 965.00	0.10
						6 175 965.00	0.10
Deutschland							
4	BAYERISCHE LB (subordinated) 4%/01-21.09.2015	2 560 000	1 460 000	4 020 000			
3	BAYERISCHE LB 3%/04-27.11.2015	2 250 000		2 250 000			
3.125	BAYERISCHE LB 3.125%/07-27.06.2018	450 000	2 700 000		3 150 000	3 463 425.00	0.05
2.75	BERLIN 2.75%/07-03.05.2017	3 505 000			3 505 000	3 703 032.50	0.06
3.125	DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRALE 3.125%/04-16.12.201	2 880 000		2 880 000			
3	DEPFA 3%/03-15.09.2015		1 100 000	1 100 000			
0.625	DEUTSCHE BANK 0.625%/15-19.12.2023		4 000 000		4 000 000	3 922 000.00	0.06
2.5	DEUTSCHE HYPOTHEKENBANK 2.5%/06-08.03.2018	2 340 000			2 340 000	2 495 610.00	0.04
2.5	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK 2.5%/05-09.03.2017	3 670 000			3 670 000	3 794 780.00	0.06
2.25	DEUTSCHE TELEKOM 2.25%/10-08.07.2016	4 390 000			4 390 000	4 474 727.00	0.07

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
3.238	DZ BANK (subordinated) 3.238%/13-30.08.2023	1 380 000			1 380 000	1 518 000.00	0.02
2	DZ BANK AG 2%/12-14.11.2017	2 860 000			2 860 000	2 960 100.00	0.05
3.125	EUROHYPO 3.125%/06-14.07.2025	600 000	100 000		700 000	875 350.00	0.01
3	HSB NORDBANK 3%/07-14.06.2019	800 000	1 300 000		2 100 000	2 360 400.00	0.04
2.125	KFW 2.125%/06-15.02.2016	2 260 000		2 260 000			
2.25	KFW 2.25%/10-12.08.2020	2 600 000			2 600 000	2 956 200.00	0.05
2.5	KFW 2.5%/05-25.08.2025	11 550 000			11 550 000	14 281 575.00	0.22
2.75	KFW 2.75%/07-16.02.2037	9 660 000			9 660 000	13 833 120.00	0.22
2.75	KFW 2.75%/09-11.10.2018	5 050 000	580 000		5 630 000	6 243 670.00	0.10
3.375	KFW 3.375%/07-30.08.2017	6 975 000	900 000		7 875 000	8 516 812.50	0.13
2	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 2%/10-01.10.20	250 000			250 000	276 875.00	0.00
3.5	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG (subordinated) 3.5%/	3 850 000		3 850 000			
2.875	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.875%/04-30.12.2015	2 920 000		2 920 000			
3	LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN 3%/04-29.12.2015	890 000		890 000			
2.5	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.5%/11-05.03.2018	250 000			250 000	269 750.00	0.00
2.625	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.625%/09-07.07.2016	260 000			260 000	267 280.00	0.00
1.75	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 1.75%/10-16.01.2017	4 600 000			4 600 000	4 746 280.00	0.07
2.125	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.125%/05-29.08.201	3 550 000			3 550 000	3 743 475.00	0.06
1.875	METRO 1.875%/12-02.05.2016	2 320 000	450 000	2 770 000			
3	MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 3%/07-12.06.2017	1 970 000			1 970 000	2 084 260.00	0.03
2.25	NORDRHEIN-WESTFALEN 2.25%/06-01.03.2019	4 470 000			4 470 000	4 901 355.00	0.08
0.875	NORTH RHINE-WESTPHALIA 0.875%/14-29.07.2024	2 500 000			2 500 000	2 672 500.00	0.04
1.625	STATE OF HESSE 1.625%/10-29.09.2016	1 000 000			1 000 000	1 023 200.00	0.02
3.125	STATE OF HESSEN 3.125%/08-30.10.2015	1 780 000	1 310 000	3 090 000			
3.25	STATE OF HESSEN 3.25%/08-22.05.2017	945 000			945 000	1 008 315.00	0.02
						96 392 092.00	1.50
Dänemark							
1.5	DANSKE BANK 1.5%/12-21.12.2016	1 400 000			1 400 000	1 426 460.00	0.02
2.375	DANSKE BANK 2.375%/09-13.01.2017	2 050 000			2 050 000	2 126 670.00	0.03
3.5	DANSKE BANK 3.5%/08-02.07.2015	880 000		880 000			
2.25	KOMMUNEKREDIT 2.25%/10-16.08.2019	1 000 000	500 000		1 500 000	1 663 500.00	0.03
2.625	KOMMUNEKREDIT 2.625%/06-17.10.2016	2 070 000			2 070 000	2 143 899.00	0.03
2.875	KOMMUNEKREDIT 2.875%/06-13.10.2031	11 130 000			11 130 000	15 326 010.00	0.24
3.25	KOMMUNEKREDIT 3.25%/08-08.05.2018	4 580 000			4 580 000	5 051 740.00	0.08
1.75	NYKREDIT BANK 1.75%/12-26.09.2016	200 000			200 000	203 520.00	0.00
						27 941 799.00	0.44
Finnland							
0.75	MUNICIPALITY FINANCE 0.75%/14-17.09.2024	3 300 000			3 300 000	3 478 200.00	0.05
0.875	MUNICIPALITY FINANCE 0.875%/13-01.02.2023	4 550 000	4 060 000		8 610 000	9 186 870.00	0.14
1.375	MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	1 550 000	300 000	900 000	950 000	1 067 800.00	0.02
1.625	MUNICIPALITY FINANCE 1.625%/11-07.02.2018	7 430 000			7 430 000	7 838 650.00	0.12
1.75	MUNICIPALITY FINANCE 1.75%/10-26.05.2017	450 000			450 000	468 225.00	0.01
2.25	MUNICIPALITY FINANCE 2.25%/10-10.12.2019	4 140 000			4 140 000	4 622 310.00	0.07
2.375	MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/09-11.03.2016	1 760 000	380 000		2 140 000	2 174 026.00	0.03
2.375	MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/11-30.03.2026	2 600 000		800 000	1 800 000	2 206 800.00	0.03
3	MUNICIPALITY FINANCE 3%/09-15.04.2021	50 000			50 000	59 275.00	0.00
1	POHJOLA BANK 1%/14-14.07.2021	3 000 000	2 550 000		5 550 000	5 844 150.00	0.09
						36 946 306.00	0.58
Frankreich							
1.75	ACCOR 1.75%/14-27.06.2022		2 000 000		2 000 000	2 106 000.00	0.03
2.5	AEROPORTS DE PARIS 2.5%/10-27.01.2017	3 700 000			3 700 000	3 844 300.00	0.06
1.875	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 1.875%/10-12.11.		200 000	200 000			
2.625	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 2.625%/10-18.02.	2 700 000			2 700 000	3 307 500.00	0.05
3	ASSISTANCE PUBLIQUE DES HOPITAUX DE PARIS 3%/08-21	840 000			840 000	872 424.00	0.01
3.375	ASSISTANCE PUBLIQUE DES HOPITAUX DE PARIS 3.375%/0	950 000		950 000			
1.5	AUCHAN 1.5%/14-03.06.2024	3 000 000	300 000		3 300 000	3 469 950.00	0.05
1.125	BFCM 1.125%/14-12.02.2019	3 000 000	50 000		3 050 000	3 159 800.00	0.05
1.125	BFCM 1.125%/14-22.05.2020	2 000 000			2 000 000	2 078 000.00	0.03
1.625	BFCM 1.625%/13-11.04.2023	860 000			860 000	914 610.00	0.01
2	BFCM 2%/14-22.05.2024	2 000 000			2 000 000	2 200 000.00	0.03
1.75	BNP PARIBAS (subordinated) 1.75%/15-05.06.2025		4 100 000		4 100 000	4 132 800.00	0.06
1.875	BNP PARIBAS 1.875%/12-12.09.2022	950 000			950 000	1 052 125.00	0.02
2.375	BNP PARIBAS HOME LOAN COVERED BONDS 2.375%/11-07.1	1 500 000			1 500 000	1 689 000.00	0.03
1.5	BPCE 1.5%/14-30.04.2021	1 500 000	50 000		1 550 000	1 660 050.00	0.03
2.375	CADES 2.375%/11-19.04.2023	5 000 000			5 000 000	5 902 500.00	0.09
3	CADES 3%/09-21.04.2021	2 500 000			2 500 000	2 940 000.00	0.05
2.5	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 2.5%/11	600 000		600 000			
1.125	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.125%/12-21.	2 950 000			2 950 000	3 041 450.00	0.05
1.625	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.625%/12-05.	4 690 000	100 000		4 790 000	5 125 300.00	0.08
1.75	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.75%/13-26.0	1 000 000			1 000 000	1 146 000.00	0.02
1.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.25%/13-16.12.	2 400 000			2 400 000	2 583 600.00	0.04
3.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.25%/07-13.11.	840 000			840 000	909 300.00	0.01
3.625	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.625%/08-16.04	3 300 000			3 300 000	3 651 450.00	0.06
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-09.08.2017	4 610 000			4 610 000	4 960 360.00	0.08
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-28.08.2019	3 725 000			3 725 000	4 272 575.00	0.07
2.375	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.375%/06-09	5 870 000		2 000 000	3 870 000	3 916 440.00	0.06
2.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.5%/09-02.0	6 510 000			6 510 000	7 017 780.00	0.11
2.625	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.625%/09-12	1 990 000			1 990 000	2 213 875.00	0.03
2	CFF 2%/10-20.12.2017	300 000			300 000	316 350.00	0.00
2.25	CFF 2.25%/10-13.10.2021	7 550 000	2 200 000		9 750 000	11 139 375.00	0.17
2.25	CFF 2.25%/11-09.08.2019	1 800 000			1 800 000	1 976 400.00	0.03
2.375	CFF 2.375%/05-24.08.2018	20 845 000	2 500 000		23 345 000	25 224 272.50	0.39
2.5	CFF 2.5%/06-24.02.2031	9 000 000			9 000 000	11 484 000.00	0.18
2.75	CFF 2.75%/04-15.11.2016	7 085 000			7 085 000	7 358 481.00	0.11
2.875	CFF 2.875%/09-10.09.2019	750 000			750 000	844 875.00	0.01
3	CFF 3%/07-07.06.2022	2 735 000	1 100 000		3 835 000	4 594 330.00	0.07
3	CFF 3%/08-19.08.2016	4 490 000			4 490 000	4 642 660.00	0.07
2.375	CIF EUROMORTGAGE 2.375%/10-05.03.2019	2 500 000			2 500 000	2 720 000.00	0.04
1.5	COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.5%/14-19.02.202		50 000		50 000	55 125.00	0.00
1	COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1%/14-06.03.202		2 000 000		2 000 000	2 150 000.00	0.03
0.5	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.5%/15-16.03.2027		4 000 000		4 000 000	4 040 000.00	0.06
1.125	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.125%/14-05.06.2024	2 000 000			2 000 000	2 159 000.00	0.03

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.125	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.125%/14-12.08.2021	2 500 000	300 000		2 800 000	2 991 800.00	0.05
1.375	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.375%/12-30.07.2018	4 500 000			4 500 000	4 718 250.00	0.07
1.75	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 1.75%/10-27.07.2017	1 450 000			1 450 000	1 512 350.00	0.02
0.55	CREDIT AGRICOLE LONDON 0.55%/15-01.09.2022		1 500 000		1 500 000	1 498 200.00	0.02
1.375	CRH 1.375%/13-15.03.2023	2 600 000			2 600 000	2 839 200.00	0.04
1.75	CRH 1.75%/11-29.03.2016	2 265 000			2 265 000	2 292 633.00	0.04
1.875	CRH 1.875%/12-23.05.2022	3 100 000			3 100 000	3 472 000.00	0.05
2.375	CRH 2.375%/12-05.03.2024	1 170 000			1 170 000	1 381 185.00	0.02
2.5	CRH 2.5%/11-29.03.2021	8 340 000	300 000		8 640 000	9 871 200.00	0.15
4.125	DANONE FINANCE 4.125%/08-20.06.2016	2 390 000			2 390 000	2 473 172.00	0.04
2.25	EDF 2.25%/10-29.09.2017	250 000			250 000	261 500.00	0.00
4	EDF 4%/09-27.03.2017	10 755 000			10 755 000	11 400 300.00	0.18
1.125	GDF SUEZ 1.125%/12-09.10.2020	4 000 000			4 000 000	4 194 000.00	0.07
1.5	GDF SUEZ 1.5%/11-20.10.2017	1 560 000			1 560 000	1 608 360.00	0.03
1.625	GDF SUEZ 1.625%/12-09.10.2024	2 850 000			2 850 000	3 132 150.00	0.05
2	HSBC SFH FRANCE 2%/10-23.04.2019	3 345 000			3 345 000	3 620 962.50	0.06
2.375	HSBC SFH FRANCE 2.375%/10-07.09.2018	2 400 000			2 400 000	2 596 800.00	0.04
2.375	ILE DE FRANCE 2.375%/05-28.12.2016	5 050 000			5 050 000	5 239 375.00	0.08
3.25	ILE DE FRANCE 3.25%/07-27.11.2018	1 690 000			1 690 000	1 889 420.00	0.03
2.5	MFINANCE FRANCE 2.5%/13-08.10.2018	2 000 000			2 000 000	2 044 000.00	0.03
1.625	ORANGE 1.625%/11-13.10.2016	1 100 000			1 100 000	1 122 000.00	0.02
3.25	PARIS 3.25%/08-05.11.2018	1 770 000			1 770 000	1 971 780.00	0.03
2.625	RATP 2.625%/06-06.11.2019	4 825 000			4 825 000	5 365 400.00	0.08
1.5	RCI BANQUE 1.50%/13-19.07.2016	500 000			500 000	506 450.00	0.01
3.375	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARIS 3.375%/08-21.0	250 000		250 000			
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/07-0	6 080 000			6 080 000	6 551 200.00	0.10
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/08-0	1 240 000			1 240 000	1 339 200.00	0.02
3.375	SANOFI 3.375%/07-21.12.2015	5 570 000		5 570 000			
2.625	SCNF RESEAU 2.625%/11-10.03.2031	300 000			300 000	388 050.00	0.01
3	SCNF RESEAU 3%/09-24.04.2019	6 540 000			6 540 000	7 334 610.00	0.11
3.25	SCNF RESEAU 3.25%/06-30.06.2032	3 650 000			3 650 000	5 172 050.00	0.08
2.25	SNCF MOBILITES 2.25%/11-25.02.2021	285 000			285 000	317 775.00	0.00
2.375	SNCF MOBILITES 2.375%/09-24.07.2019	5 750 000			5 750 000	6 316 375.00	0.10
2.625	SNCF MOBILITES 2.625%/06-13.12.2021	6 100 000			6 100 000	7 066 850.00	0.11
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-11.06.2018	2 240 000			2 240 000	2 424 800.00	0.04
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-23.01.2019	4 080 000			4 080 000	4 492 080.00	0.07
2	SNCF RESEAU 2%/10-12.11.2026	5 000 000	100 000	900 000	4 200 000	4 932 900.00	0.08
2.875	SNCF RESEAU 2.875%/09-26.02.2021	2 020 000			2 020 000	2 351 280.00	0.04
0.875	SOCIETE GENERALE 0.875%/13-19.06.2018	1 410 000	100 000		1 510 000	1 543 975.00	0.02
1.875	SOCIETE GENERALE 1.875%/10-19.10.2015	2 260 000		2 260 000			
2.375	SOCIETE GENERALE 2.375%/12-19.09.2022	1 850 000			1 850 000	2 058 125.00	0.03
2.375	TOTAL CAPITAL 2.375%/06-13.01.2016	3 100 000	1 170 000	4 270 000			
3.125	TOTAL CAPITAL 3.125%/06-28.06.2018	12 120 000	100 000		12 220 000	13 356 460.00	0.21
0.5	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 0.5%/15-01.06.2027		1 000 000		1 000 000	968 500.00	0.02
1	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 1%/14-29.08.2024	4 840 000			4 840 000	5 062 640.00	0.08
2	UNIBAIL-RODAMCO 2%/13-20.11.2023	1 010 000			1 010 000	1 135 745.00	0.02
2.125	VINCI 2.125%/11-15.12.2017	2 640 000			2 640 000	2 764 080.00	0.04
3	VINCI 3%/12-24.01.2022	250 000			250 000	286 125.00	0.00
						310 737 365.00	4.85
Guernsey							
0.625	CREDIT SUISSE GROUP FUNDING (GUERNSEY) 0.625%/15-2		5 000 000		5 000 000	4 985 000.00	0.08
1	CS GROUP FUNDING 1%/15-14.04.2023		12 500 000		12 500 000	12 475 000.00	0.19
						17 460 000.00	0.27
Honduras							
1.125	CABEI 1.125%/14-24.02.2023	5 000 000			5 000 000	5 210 000.00	0.08
0.625	CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.	1 000 000			1 000 000	1 009 600.00	0.02
1.5	CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 1.5	1 500 000			1 500 000	1 592 250.00	0.02
						7 811 850.00	0.12
Hongkong							
0.875	BK OF COMMUNICATIONS - HONG KONG BRANCH 0.875%/14-	3 500 000			3 500 000	3 526 250.00	0.06
1.375	CHINA CONSTRUCTION BANK 1.375%/14-28.05.2019	1 750 000	100 000		1 850 000	1 877 750.00	0.03
						5 404 000.00	0.08
Indien							
3	BHARAT PETROLEUM 3%/14-20.12.2019	3 830 000	450 000		4 280 000	4 611 700.00	0.07
3.5	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.5%/11-13.04.2016	500 000			500 000	509 600.00	0.01
						5 121 300.00	0.08
Internationale Organisationen							
2.625	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.625%/09-25.03.2019	6 390 000			6 390 000	7 096 095.00	0.11
2.75	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75%/10-12.02.2030	2 830 000	300 000		3 130 000	4 151 945.00	0.06
1.625	BEI 1.625%/12-02.04.2026	2 740 000			2 740 000	3 152 370.00	0.05
1.625	BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK 1.625%/15-20.		2 490 000		2 490 000	2 497 470.00	0.04
2.5	BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK 2.5%/12-04.10	300 000			300 000	302 130.00	0.00
0.194	CABEI 0.194%/15-19.11.2021		2 500 000		2 500 000	2 478 750.00	0.04
1.875	CABEI 1.875%/14-25.02.2022	90 000	1 800 000		1 890 000	2 071 440.00	0.03
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/12-11.09.2018	2 250 000			2 250 000	2 361 375.00	0.04
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/13-13.08.2020	2 000 000			2 000 000	2 139 000.00	0.03
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/14-01.12.2028	6 200 000	1 800 000		8 000 000	8 620 000.00	0.13
2	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024	3 050 000	440 000		3 490 000	3 917 525.00	0.06
3.375	COUNCIL OF EUROPE 3.375%/08-06.11.2020	2 670 000			2 670 000	3 194 655.00	0.05
1.125	EIB 1.125%/12-26.04.2023	3 700 000			3 700 000	4 034 850.00	0.06
1.25	EIB 1.25%/12-02.08.2019	5 050 000			5 050 000	5 408 550.00	0.08
1.375	EIB 1.375%/13-21.02.2028	1 500 000			1 500 000	1 703 250.00	0.03
1.5	EIB 1.5%/12-02.08.2024	2 500 000			2 500 000	2 822 500.00	0.04
1.625	EIB 1.625%/11-23.11.2023	9 320 000	100 000		9 420 000	10 686 990.00	0.17
1.75	EIB 1.75%/10-21.04.2017	1 235 000	90 000		1 325 000	1 376 012.50	0.02
1.75	EIB 1.75%/13-28.06.2033	2 500 000			2 500 000	3 050 000.00	0.05
2	EIB 2%/10-24.08.2022	9 980 000			9 980 000	11 481 990.00	0.18
2.125	EIB 2.125%/10-22.01.2020	2 800 000			2 800 000	3 130 400.00	0.05
2.375	EIB 2.375%/05-10.07.2020	20 320 000			20 320 000	23 144 480.00	0.36
2.5	EIB 2.5%/07-08.02.2019	9 950 000			9 950 000	11 024 600.00	0.17
2.625	EIB 2.625%/10-11.02.2025	2 900 000			2 900 000	3 585 850.00	0.06
3	EIB 3%/09-14.04.2021	2 400 000			2 400 000	2 853 600.00	0.04

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
3.125	EIB 3.125%/06-30.06.2036	8 655 000			8 655 000	13 025 775.00	0.20
3.25	EIB 3.25%/08-30.04.2018	3 260 000	2 500 000		5 760 000	6 370 560.00	0.10
3.375	EIB 3.375%/07-15.10.2027	2 265 000	400 000		2 665 000	3 648 385.00	0.06
2.75	IADB 2.75%/09-15.04.2019	4 180 000			4 180 000	4 694 140.00	0.07
2.5	NORDIC INVESTMENT BANK 2.5%/09-11.04.2018	9 100 000	380 000		9 480 000	10 271 580.00	0.16
						164 296 267.50	2.56
Irland							
2.125	DEPFA ACS BANK 2.125%/05-13.10.2017	840 000			840 000	869 820.00	0.01
2.375	DEPFA ACS BANK 2.375%/06-15.02.2019	2 365 000			2 365 000	2 518 725.00	0.04
3.25	DEPFA ACS BANK 3.25%/06-31.07.2031	1 970 000			1 970 000	2 407 340.00	0.04
3.375	UNICREDIT BANK IRELAND 3.375%/12-25.10.2017	3 080 000		280 000	2 800 000	2 990 400.00	0.05
4.25	UNICREDIT BANK IRELAND 4.25%/12-19.10.2022	850 000			850 000	1 031 475.00	0.02
						9 817 760.00	0.15
Italien							
2.5	ITALY 2.5%/06-30.01.2018	17 720 000			17 720 000	18 747 760.00	0.29
						18 747 760.00	0.29
Jersey							
3	ASIF III 3%/04-29.12.2015	500 000		500 000			
2.5	HEATHROW FUNDING C. A 2.5%/12-08.02.2017	975 000			975 000	1 009 612.50	0.02
2.75	UBS JERSEY BRANCH (subordinated) 2.75%/06-28.04.20	5 410 000	1 135 000		6 545 000	6 668 700.50	0.10
						7 678 313.00	0.12
Kanada							
2.875	BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.11.2018	4 400 000			4 400 000	4 892 800.00	0.08
2.875	BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.12.2017	2 500 000			2 500 000	2 700 000.00	0.04
1	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 1%/12-13.02.201	2 460 000			2 460 000	2 574 390.00	0.04
1.75	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE LONDON 1.75%/10	6 760 000			6 760 000	7 030 400.00	0.11
2.625	EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.625%/09-24.07.2017	2 930 000	770 000		3 700 000	3 934 950.00	0.06
2.875	PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 2.875%/09-04.03.2016	8 360 000	900 000	9 000 000	260 000	264 680.00	0.00
2.375	PROVINCE OF ONTARIO 2.375%/10-07.05.2020	3 800 000	3 300 000		7 100 000	8 023 000.00	0.13
2.5	PROVINCE OF ONTARIO 2.5%/09-04.12.2019	3 800 000			3 800 000	4 278 800.00	0.07
3.375	PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-01.12.2015	3 345 000		3 345 000			
3.375	PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-27.05.2016	1 950 000		1 000 000	950 000	977 170.00	0.02
3.375	PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/09-29.04.2019	1 410 000			1 410 000	1 609 515.00	0.03
3.75	PROVINCE OF ONTARIO 3.75%/08-30.07.2018	7 160 000	3 190 000		10 350 000	11 654 100.00	0.18
1.5	PROVINCE OF QUEBEC 1.5%/14-05.02.2024	2 000 000	50 000		2 050 000	2 281 650.00	0.04
0.75	QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024	4 400 000			4 400 000	4 617 800.00	0.07
1.125	QUEBEC 1.125%/13-22.02.2023	1 400 000	3 960 000		5 360 000	5 772 720.00	0.09
2.25	QUEBEC 2.25%/05-05.10.2015	1 870 000		1 870 000			
2.625	QUEBEC 2.625%/06-21.06.2017	8 250 000			8 250 000	8 724 375.00	0.14
2.875	QUEBEC 2.875%/09-17.12.2021	2 250 000			2 250 000	2 687 625.00	0.04
3.125	QUEBEC 3.125%/09-11.12.2015	1 000 000		1 000 000			
3.375	QUEBEC 3.375%/08-19.01.2018	1 650 000			1 650 000	1 804 275.00	0.03
3.875	QUEBEC 3.875%/09-11.12.2018	6 500 000	1 000 000		7 500 000	8 572 500.00	0.13
0.625	ROYAL BANK OF CANADA 0.625%/14-09.04.2019	2 000 000			2 000 000	2 047 000.00	0.03
2.25	ROYAL BANK OF CANADA 2.25%/11-21.04.2021	7 350 000	300 000		7 650 000	8 694 225.00	0.14
0.75	ROYAL BK CANADA TORONTO BRANCH 0.75%/13-23.10.2018	5 250 000	100 000		5 350 000	5 478 400.00	0.09
2.125	SASKATCHEWAN 2.125%/05-15.01.2016	6 580 000		6 580 000			
						98 620 375.00	1.54
Kasachstan							
2.59	NATIONAL COMPANY KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY 2.59%/14-2	1 000 000			1 000 000	966 500.00	0.02
3.638	NATIONAL COMPANY KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY 3.638%/14-	4 000 000			4 000 000	3 762 000.00	0.06
						4 728 500.00	0.07
Liechtenstein							
0.875	HILTI 0.875%/13-30.10.2018	1 520 000		140 000	1 380 000	1 412 430.00	0.02
1.875	HILTI 1.875%/13-30.10.2023	1 000 000			1 000 000	1 116 000.00	0.02
1.5	LGT BANK 1.5%/14-10.05.2021	4 600 000	50 000	110 000	4 540 000	4 887 310.00	0.08
1.875	LGT BANK 1.875%/13-08.02.2023	500 000	250 000		750 000	833 625.00	0.01
2	LGT BANK IN LIECHTENSTEIN 2%/12-02.07.2019	4 750 000			4 750 000	5 108 625.00	0.08
2.5	VP BANK 2.5%/10-27.05.2016	2 250 000			2 250 000	2 290 725.00	0.04
						15 648 715.00	0.24
Litauen							
2	LITHUANIA 2%/12-11.04.2018	900 000			900 000	947 250.00	0.01
						947 250.00	0.01
Luxemburg							
3	DEPFA PFANDBRIEF BANK INTERNATIONAL 3%/06-16.06.20	200 000		200 000			
3.125	DEPFA PFANDBRIEFBANK INTERNATIONAL 3.125%/06-31.08	10 645 000	1 200 000	11 845 000			
1.625	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/14-040225	8 000 000			8 000 000	9 148 000.00	0.14
2.85	GAZ CAPITAL 2.85%/13-25.10.2019	6 615 000		6 615 000			
1.25	GLENCORE FINANCE 1.25%/14-01.12.2020	6 000 000			6 000 000	5 892 000.00	0.09
2.125	GLENCORE FINANCE 2.125%/13-23.12.2019	2 260 000	1 510 000		3 770 000	3 864 250.00	0.06
2.625	GLENCORE FINANCE 2.625%/12-03.12.2018	6 350 000			6 350 000	6 635 750.00	0.10
3.625	GLENCORE FINANCE 3.625%/10-06.04.2016	8 550 000		5 000 000	3 550 000	3 616 740.00	0.06
3.125	NORD/LB COVERED FINANCE BANK 3.125%/07-17.12.2015	1 530 000		1 530 000			
2.065	SB CAPITAL 2.065%/13-28.02.2017	2 600 000		2 600 000			
3.15	VTB CAPITAL 3.15%/12-16.12.2016	8 850 000		8 850 000			
						29 156 740.00	0.46
Mexiko							
1.125	AMERICA MOVIL 1.125%/12-12.09.2018	5 300 000	60 000	280 000	5 080 000	5 219 700.00	0.08
2	AMERICA MOVIL 2%/11-27.12.2017	2 765 000	100 000		2 865 000	2 995 357.50	0.05
0.75	MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO SAPI DE CV 0.75%/14	500 000			500 000	504 000.00	0.01
2.5	PETROLEOS MEXICANOS 2.5%/12-10.04.2019	4 350 000			4 350 000	4 611 000.00	0.07
						13 330 057.50	0.21
Neuseeland							
1.125	AUCKLAND COUNCIL 1.125%/13-07.02.2024	2 000 000	980 000		2 980 000	3 236 280.00	0.05
1.5	BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.5%/12-22.01.2018	1 600 000			1 600 000	1 658 400.00	0.03
0.875	KIWI BANK 0.875%/14-04.04.2019	2 000 000			2 000 000	2 058 000.00	0.03
1	KIWI BANK 1%/13-23.12.2020	1 650 000			1 650 000	1 745 700.00	0.03
						8 698 380.00	0.14
Niederlande							
1	ABN AMRO BANK 1%/12-19.04.2017	5 100 000			5 100 000	5 207 100.00	0.08
1.125	ABN AMRO BANK 1.125%/13-25.10.2018	1 500 000			1 500 000	1 547 250.00	0.02
1.125	ABN AMRO BANK 1.125%/14-24.04.2020	2 000 000			2 000 000	2 091 000.00	0.03

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.125	ABN AMRO BANK 1.125%/14-31.01.2019	4 500 000	50 000		4 550 000	4 704 700.00	0.07
1.5	ABN AMRO BANK 1.5%/12-18.07.2023	1 300 000			1 300 000	1 435 850.00	0.02
1.5	ABN AMRO BANK 1.5%/13-27.12.2019		100 000		100 000	105 950.00	0.00
1.625	ABN AMRO BANK 1.625%/10-28.10.2016	1 900 000			1 900 000	1 945 600.00	0.03
2.25	ABN AMRO BANK 2.25%/11-10.07.2018	4 550 000			4 550 000	4 877 600.00	0.08
2.375	ABN AMRO BANK 2.375%/11-02.02.2016	2 280 000		2 280 000			
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/06-30.12.2015	6 205 000		6 200 000	5 000	5 051.50	0.00
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/12-16.02.2017	2 350 000			2 350 000	2 432 250.00	0.04
2.625	ABN AMRO BANK 2.625%/11-27.04.2021	1 800 000			1 800 000	2 057 400.00	0.03
3.125	ABN AMRO BANK 3.125%/11-27.04.2021	2 000 000			2 000 000	2 325 000.00	0.04
3.375	ABN AMRO BANK 3.375%/06-15.08.2031	600 000			600 000	851 400.00	0.01
1.5	ACHMEA 1.5%/13-19.06.2019		100 000		100 000	104 650.00	0.00
3.5	ACHMEA BANK 3.5%/07-22.08.2017	5 400 000			5 400 000	5 775 300.00	0.09
2.25	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN 2.25%/11-23.02.2021	6 050 000	300 000		6 350 000	7 251 700.00	0.11
3	BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL NETHERLANDS 3%/14-31.0	7 000 000			7 000 000	7 490 000.00	0.12
1.75	BMW FINANCE 1.75%/11-29.09.2017	3 790 000	200 000		3 990 000	4 139 625.00	0.06
1.25	BNG 1.25%/14-30.04.2024	4 000 000	100 000		4 100 000	4 518 200.00	0.07
1.5	BNG 1.5%/10-03.11.2017	640 000	1 100 000		1 740 000	1 821 780.00	0.03
2.125	BNG 2.125%/10-06.11.2018	4 060 000			4 060 000	4 405 100.00	0.07
2.25	BNG 2.25%/05-14.10.2020	22 070 000	400 000		22 470 000	25 582 095.00	0.40
2.375	BNG 2.375%/10-19.11.2019	200 000			200 000	224 200.00	0.00
2.5	BNG 2.5%/05-21.07.2025	11 265 000		800 000	10 465 000	12 861 485.00	0.20
2.5	BNG 2.5%/09-14.10.2019	6 000 000			6 000 000	6 744 000.00	0.11
2.625	BNG 2.625%/07-09.02.2017	3 530 000			3 530 000	3 694 145.00	0.06
2.75	BNG 2.75%/09-11.05.2016	2 150 000			2 150 000	2 199 880.00	0.03
3.125	BNG 3.125%/07-02.07.2018	1 910 000			1 910 000	2 118 190.00	0.03
3.25	BNG 3.25%/07-29.06.2037	4 740 000		650 000	4 090 000	6 269 970.00	0.10
1.625	DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE 1.625%/11-12.10.2016	2 100 000			2 100 000	2 138 850.00	0.03
0.75	DEUTSCHE BAHN FINANCE 0.75%/12-21.08.2017	450 000			450 000	459 675.00	0.01
1.375	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.375%/13-24.07.2023	5 410 000		170 000	5 240 000	5 743 040.00	0.09
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/11-18.12.2017	3 770 000			3 770 000	3 935 880.00	0.06
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/12-21.02.2024	500 000			500 000	550 750.00	0.01
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/14-26.08.2024	5 000 000	100 000	130 000	4 970 000	5 489 365.00	0.09
1.75	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.75%/10-03.06.2020	10 820 000	400 000		11 220 000	12 257 850.00	0.19
0.625	EBN 0.625%/12-04.07.2019	1 500 000			1 500 000	1 546 500.00	0.02
0.75	EBN 0.75%/11-03.10.2016	3 600 000			3 600 000	3 643 200.00	0.06
0.875	EBN 0.875%/14-22.09.2026	9 000 000		150 000	8 850 000	9 279 225.00	0.14
1.125	EBN 1.125%/12-04.07.2024	430 000			430 000	467 625.00	0.01
2.125	EBN 2.125%/10-27.04.2020	7 120 000	500 000		7 620 000	8 408 670.00	0.13
1.25	ENBW INTERNATIONAL FINANCE 1.25%/13-12.07.2018		100 000		100 000	103 250.00	0.00
2	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 2%/11-23.12.2015	960 000		960 000			
2.75	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 2.75%/12-17.12.2018	3 750 000			3 750 000	4 048 125.00	0.06
3	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 3%/11-23.06.2020	3 970 000			3 970 000	4 408 685.00	0.07
4	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4%/12-26.10.2027	1 650 000			1 650 000	2 038 575.00	0.03
2.125	F.VAN LANSCHOT BANKIERS 2.125%/12-04.04.2016	4 300 000	1 115 000		5 415 000	5 475 648.00	0.09
2.125	GAS NATURAL FINANCE 2.125%/13-08.02.2019	2 000 000			2 000 000	2 120 000.00	0.03
3	IBERDROLA INTERNATIONAL 3%/12-13.02.2017	3 800 000			3 800 000	3 963 400.00	0.06
1	ING BANK 1%/13-14.09.2018	3 500 000	150 000	140 000	3 510 000	3 613 545.00	0.06
1.875	ING BANK 1.875%/10-29.08.2018	6 350 000			6 350 000	6 769 100.00	0.11
2.125	ING BANK 2.125%/10-07.10.2016	3 660 000			3 660 000	3 742 716.00	0.06
2.625	ING BANK 2.625%/11-23.03.2021	1 360 000			1 360 000	1 564 680.00	0.02
2.25	LEASEPLAN 2.25%/12-18.07.2016	500 000			500 000	509 550.00	0.01
2.375	LEASEPLAN 2.375%/12-15.10.2020	1 500 000			1 500 000	1 629 750.00	0.03
2.625	NEDERLANDEN FINANCIERINGS MAAT 2.625%/08-22.09.201	2 110 000	390 000	2 500 000			
2.875	NEDERLANDSE FINANCIERINGS-MAATSCHAPPIJ VOOR ONTWIK	1 400 000			1 400 000	1 441 720.00	0.02
1	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1%/12-01.02.2018	600 000			600 000	623 700.00	0.01
1.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.375%/12-13.09.2027	250 000		250 000			
1.75	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.75%/10-22.07.2016	5 420 000			5 420 000	5 531 110.00	0.09
1.875	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.875%/10-03.02.2020	2 250 000			2 250 000	2 493 000.00	0.04
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.25%/10-03.09.2019	4 350 000			4 350 000	4 832 850.00	0.08
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.25%/11-24.02.2021	900 000			900 000	1 027 800.00	0.02
2.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.375%/05-19.08.2020	5 350 000	300 000		5 650 000	6 435 350.00	0.10
2.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.375%/06-27.01.2023	7 210 000			7 210 000	8 507 800.00	0.13
2.5	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.5%/06-27.12.2018	11 250 000			11 250 000	12 403 125.00	0.19
2.625	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.625%/07-07.02.2022	2 090 000	300 000		2 390 000	2 829 760.00	0.04
3.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 3.25%/06-07.08.2029	2 915 000			2 915 000	4 025 615.00	0.06
3	NIBC BANK 3%/13-19.12.2016	480 000			480 000	495 120.00	0.01
1.125	NV BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN BNG 1.125%/12-13.09.	3 720 000	1 845 000		5 565 000	6 051 937.50	0.09
1.125	NV BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN BNG 1.125%/13-19.04.	1 500 000	100 000		1 600 000	1 739 200.00	0.03
1.125	PACCAR FINANCIAL EUROPE 1.125%/12-06.03.2017		150 000		150 000	152 175.00	0.00
1.25	RABOBANK 1.25%/12-15.10.2020	3 000 000		1 000 000	2 000 000	2 112 000.00	0.03
2	RABOBANK 2%/10-16.09.2021	11 310 000			11 310 000	12 514 515.00	0.20
2	RABOBANK 2%/11-31.01.2018	1 350 000			1 350 000	1 417 500.00	0.02
2	RABOBANK 2%/12-06.02.2019	5 000 000			5 000 000	5 342 500.00	0.08
2.125	RABOBANK 2.125%/05-11.10.2017	8 250 000			8 250 000	8 641 875.00	0.13
3	RABOBANK 3%/09-10.06.2016	1 065 000		1 065 000			
3.125	RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	7 140 000	100 000		7 240 000	9 115 160.00	0.14
3.5	RABOBANK 3.5%/07-31.08.2023	3 750 000			3 750 000	4 650 000.00	0.07
3.625	RABOBANK 3.625%/09-02.07.2019	4 250 000		120 000	4 130 000	4 697 875.00	0.07
1	RABOBANK NEDERLAND 1%/13-26.06.2020	3 000 000			3 000 000	3 130 500.00	0.05
1.125	RABOBANK NEDERLAND 1.125%/14-08.04.2021	3 500 000	1 850 000	90 000	5 260 000	5 536 150.00	0.09
0.375	SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.375%/15-21.08.2023		8 000 000		8 000 000	8 020 000.00	0.13
0.875	SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.875%/15-21.08.2028		6 700 000		6 700 000	6 706 700.00	0.10
3.875	WUERTH FINANCE INTERNATIONAL 3.875%/09-03.08.2015	3 715 000		3 715 000			
						349 169 163.00	5.45
Norwegen							
1.75	DNB BANK ASA 1.75%/12-18.04.2018	9 010 000			9 010 000	9 424 460.00	0.15
1.5	DNB BOLIGKREDITT 1.5%/11-24.02.2017	3 300 000			3 300 000	3 395 700.00	0.05
1.875	DNB BOLIGKREDITT 1.875%/11-02.02.2016	1 040 000		1 040 000			
2.25	DNB BOLIGKREDITT 2.25%/10-26.03.2018	1 055 000			1 055 000	1 127 267.50	0.02
3.375	DNB BOLIGKREDITT 3.375%/07-16.11.2016	2 155 000			2 155 000	2 256 285.00	0.04
2.875	KOMMUNALBANKEN 2.875%/09-09.05.2017	7 870 000			7 870 000	8 326 460.00	0.13

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.125	NORWEGIAN RAILWAYS 1.125%/13-02.05.2023		100 000		100 000	106 150.00	0.00
1.375	NORWEGIAN RAILWAYS 1.375%/10-15.11.2017	4 120 000			4 120 000	4 284 800.00	0.07
2.125	NORWEGIAN RAILWAYS 2.125%/11-14.02.2020	4 370 000	300 000	130 000	4 540 000	4 964 490.00	0.08
0.875	SPAREBANK 1 SR BANK 0.875%/13-30.11.2018	5 700 000	100 000		5 800 000	5 942 100.00	0.09
0.875	SPAREBANK 1 SR BANK 0.875%/14-02.12.2020	1 500 000			1 500 000	1 549 500.00	0.02
2.625	STATNETT 2.625%/06-15.12.2017	3 000 000			3 000 000	3 183 000.00	0.05
2.375	STATNETT SF S. 30 2.375%/11-08.02.2021	1 250 000			1 250 000	1 404 375.00	0.02
						45 964 587.50	0.72
Oesterreich							
2.5	AUSTRIA 2.5%/09-14.07.2016	7 720 000		5 000 000	2 720 000	2 790 992.00	0.04
4.5	BAWAG PSK 4.5%/00-16.10.2015	2 500 000		900 000	1 600 000	1 608 000.00	0.03
2.125	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 2.125%/05-12.	1 100 000			1 100 000	1 180 850.00	0.02
3.125	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.125%/06-01.	1 065 000			1 065 000	1 426 035.00	0.02
3.25	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/07-16.0	6 580 000			6 580 000	7 435 400.00	0.12
3.25	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/08-02.1	2 050 000			2 050 000	2 208 875.00	0.03
2.75	ERSTE GROUP BANK 2.75%/07-10.12.2015	610 000	300 000	910 000			
3.25	ERSTE GROUP BANK 3.25%/07-10.07.2017	300 000			300 000	314 100.00	0.00
2.5	HETA ASSET RESOLUTION 2.5%/05-13.06.2016	640 000		640 000			
2.25	HYPO INVESTMENTBANK 2.25%/05-02.08.2017	5 590 000			5 590 000	5 757 700.00	0.09
2.875	HYPO NOE GRUPPE BANK 2.875%/07-22.02.2016	4 330 000			4 330 000	4 373 300.00	0.07
2.375	HYPO TIROL BANK 2.375%/05-21.03.2017	7 955 000		7 955 000			
2.375	HYPO TIROL BANK 2.375%/06-13.09.2017	1 845 000		1 845 000			
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-15.03.2017	2 535 000			2 535 000	2 547 675.00	0.04
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-26.08.2020	1 540 000			1 540 000	1 540 000.00	0.02
2.5	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.5%/06-14.02.2022	5 730 000			5 730 000	5 641 185.00	0.09
3.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 3.375%/06-22.06.2026	5 570 000			5 570 000	5 617 345.00	0.09
0.375	LAND NIEDEROESTERREICH 0.375%/14-27.04.2021	250 000			250 000	253 625.00	0.00
2.125	LAND NIEDEROESTERREICH 2.125%/10-15.08.2017	7 320 000			7 320 000	7 664 040.00	0.12
2.625	NIEDEROESTERREICHISCHE LHB 2.625%/06-07.02.2017	4 790 000			4 790 000	4 938 490.00	0.08
2.5	OBEROESTERREICHISCHE LB 2.5%/06-20.06.2017	1 740 000			1 740 000	1 792 200.00	0.03
2.75	OBEROESTERREICHISCHE LB 2.75%/07-19.08.2016	3 140 000			3 140 000	3 210 650.00	0.05
1	OEKB 1%/12-28.09.2021	1 250 000			1 250 000	1 340 000.00	0.02
1.125	OEKB 1.125%/12-24.05.2018	590 000			590 000	616 255.00	0.01
1.75	OEKB 1.75%/11-14.06.2017	2 435 000			2 435 000	2 532 400.00	0.04
1.75	OEKB 1.75%/12-24.05.2023	3 700 000	1 760 000		5 460 000	6 180 720.00	0.10
2.125	OEKB 2.125%/05-18.10.2018	4 930 000			4 930 000	5 331 795.00	0.08
2.125	OEKB 2.125%/11-23.07.2019	2 550 000			2 550 000	2 805 000.00	0.04
2.625	OEKB 2.625%/06-22.11.2024	9 700 000			9 700 000	11 877 650.00	0.19
2.75	OEKB 2.75%/05-28.01.2020	9 230 000			9 230 000	10 545 275.00	0.16
2.875	OEKB 2.875%/05-25.02.2030	14 985 000	5 000 000	800 000	19 185 000	25 535 235.00	0.40
3	OEKB 3%/07-14.06.2022	5 090 000	300 000		5 390 000	6 524 595.00	0.10
3	OEKB 3%/08-06.10.2016	950 000			950 000	985 910.00	0.02
3.25	OEKB 3.25%/06-25.07.2036	3 300 000			3 300 000	4 966 500.00	0.08
1.125	OEKBOESTERREICHISCHE KONTROLLBANK 1.125%/13-24.07.	4 100 000	100 000		4 200 000	4 510 800.00	0.07
2.125	PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.125%/	4 085 000		4 085 000			
2.5	PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.5%/05	7 945 000		7 945 000			
2.875	PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.875%/	13 935 000	1 650 000	15 585 000			
1	RAIFFEISEN LANDESBANK NIEDEROESTERREICH-WIEN 1%/12	2 710 000	100 000		2 810 000	2 902 730.00	0.05
1	RAIFFEISENLANDESBANK OBEROESTERREICH 1%/12-07.11.2	970 000			970 000	956 032.00	0.01
1.375	VORARLBERGER LANDES UND HYPOTHEKENBANK 1.375%/13-2	1 350 000	100 000	320 000	1 130 000	1 119 830.00	0.02
2.375	VORARLBERGER LHB 2.375%/06-09.08.2017	7 625 000			7 625 000	7 884 250.00	0.12
2.5	VORARLBERGER LHB 2.5%/05-15.02.2016	7 700 000	350 000		8 050 000	8 110 375.00	0.13
2.625	VORARLBERGER LHB 2.625%/06-09.11.2015	480 000		480 000			
2.625	VORARLBERGER LHB 2.625%/09-30.10.2019	500 000			500 000	549 250.00	0.01
						165 575 064.00	2.58
Panama							
1.625	BANCO GENERAL 1.625%/14-18.06.2018	1 500 000			1 500 000	1 515 000.00	0.02
						1 515 000.00	0.02
Peru							
1.25	FONDO MIVIVIENDA 1.25%/14-13.06.2018	2 350 000		130 000	2 220 000	2 266 620.00	0.04
						2 266 620.00	0.04
Polen							
	POLAND 0%/15-08.05.2018		1 500 000		1 500 000	1 503 000.00	0.02
1	POLAND 1%/14-17.09.2021	4 200 000	2 370 000		6 570 000	6 878 790.00	0.11
2.25	POLAND 2.25%/12-15.05.2018	1 300 000	150 000		1 450 000	1 544 250.00	0.02
2.75	POLAND 2.75%/11-25.02.2016	15 700 000	1 000 000	6 500 000	10 200 000	10 345 860.00	0.16
3.25	POLAND 3.25%/07-15.05.2019	8 370 000			8 370 000	9 391 140.00	0.15
3.625	POLAND 3.625%/08-21.04.2017	4 525 000			4 525 000	4 807 812.50	0.08
						34 470 852.50	0.54
Schweden							
1.5	AKADEMISKA HUS 1.5%/11-20.04.2016	2 190 000			2 190 000	2 217 813.00	0.03
2.125	AKADEMISKA HUS 2.125%/10-04.07.2018	150 000	1 000 000		1 150 000	1 236 825.00	0.02
2.25	AKADEMISKA HUS 2.25%/11-22.02.2021	1 150 000			1 150 000	1 303 525.00	0.02
2.5	KOMMUNINVEST I SVERIGE 2.5%/09-04.12.2015	2 490 000		2 490 000			
2.625	KOMMUNINVEST I SVERIGE 2.625%/07-07.12.2016	1 430 000			1 430 000	1 487 486.00	0.02
1.25	KOMMUNINVEST I SVERIGE AB 1.25%/12-28.02.2022	3 650 000	700 000		4 350 000	4 730 625.00	0.07
0.875	LANDSHYPOTEK 0.875%/14-16.09.2024	1 000 000			1 000 000	1 032 000.00	0.02
1.5	LANDSHYPOTEK 1.5%/10-13.12.2016	1 500 000			1 500 000	1 536 000.00	0.02
1.5	LANDSHYPOTEK 1.5%/11-24.10.2018	2 650 000			2 650 000	2 806 350.00	0.04
1	LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 1%/12-29.05.2019	3 310 000			3 310 000	3 447 365.00	0.05
1.125	LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB 1.125%/13-11.04.2023	1 350 000	100 000		1 450 000	1 559 475.00	0.02
0.55	NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025		4 600 000		4 600 000	4 636 800.00	0.07
0.75	NORDEA BANK 0.75%/14-04.10.2019	2 500 000		90 000	2 410 000	2 482 300.00	0.04
0.875	NORDEA BANK 0.875%/13-25.09.2018	2 740 000	100 000		2 840 000	2 918 100.00	0.05
1.125	NORDEA BANK 1.125%/12-02.10.2020	5 300 000	500 000		5 800 000	6 113 200.00	0.10
1.5	NORDEA BANK 1.5%/12-29.09.2017	5 080 000			5 080 000	5 245 100.00	0.08
2.75	NORDEA BANK 2.75%/11-22.03.2021	2 820 000			2 820 000	3 240 180.00	0.05
2.25	NORDEA BANK AB 2.25%/10-06.05.2016	5 550 000		5 550 000			
1.875	NORDEA HYPOTEK 1.875%/10-07.06.2016	810 000	300 000		1 110 000	1 130 313.00	0.02
2.536	PKO FINANCE 2.536%/12-21.12.2015	3 665 000		3 665 000			
3.538	PKO FINANCE 3.538%/11-07.07.2016	2 750 000			2 750 000	2 820 400.00	0.04
2	SBAB BANK 2%/11-06.12.2018	1 550 000	100 000		1 650 000	1 749 000.00	0.03

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.125	SCBC 2.125%/10-15.02.2017	7 025 000			7 025 000	7 291 950.00	0.11
2	STADSHYPOTEK 2%/10-01.12.2016	2 260 000	240 000		2 500 000	2 580 000.00	0.04
0.625	SVENSKA HANDELSBANKEN 0.625%/14-11.12.2018	2 500 000		150 000	2 350 000	2 405 225.00	0.04
1.25	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/13-20.12.2019	4 090 000	600 000	150 000	4 540 000	4 782 890.00	0.07
1.375	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.375%/12-05.10.2022	1 900 000			1 900 000	2 059 600.00	0.03
1.625	SWEDBANK MORTGAGE 1.625%/10-08.12.2017	3 000 000			3 000 000	3 139 500.00	0.05
2.125	SWEDBANK MORTGAGE 2.125%/10-26.08.2016	1 815 000			1 815 000	1 863 279.00	0.03
2.5	SWEDBANK MORTGAGE 2.5%/11-03.06.2022	3 710 000			3 710 000	4 344 410.00	0.07
2.125	SWEDISH COVERED BOND CORPORATION 2.125%/09-08.06.2	2 740 000	300 000		3 040 000	3 102 320.00	0.05
1.25	SWEDISH EXPORT CREDIT 1.25%/13-17.07.2023	1 000 000	300 000		1 300 000	1 424 800.00	0.02
1.875	SWEDISH EXPORT CREDIT 1.875%/10-08.03.2017	500 000			500 000	518 750.00	0.01
2.625	SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/07-09.02.2017	8 465 000			8 465 000	8 858 622.50	0.14
2.625	SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/09-28.12.2015	5 010 000		5 010 000			
3	SWEDISH EXPORT CREDIT 3%/09-27.02.2018	1 330 000			1 330 000	1 447 705.00	0.02
						95 511 908.50	1.49
Schweiz							
0.625	AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.625%/15-13.04.2028		1 250 000		1 250 000	1 255 625.00	0.02
0.875	AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.875%/15-23.01.2030	5 000 000	1 200 000		6 200 000	6 355 000.00	0.10
1	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1%/14-19.06.2023	3 400 000			3 400 000	3 614 200.00	0.06
1.125	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.125%/11-15.11.2018	500 000	150 000		650 000	678 275.00	0.01
1.6	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.6%/12-18.05.2037	750 000			750 000	860 625.00	0.01
2	AARGAUISCHE KANTONALBANK 2%/09-09.09.2016	330 000			330 000	337 953.00	0.01
2.25	AARGAUISCHE KANTONALBANK 2.25%/06-26.01.2016	4 945 000		4 945 000			
3.5	AARGAUISCHE KANTONALBANK 3.5%/08-14.08.2017	1 510 000			1 510 000	1 620 985.00	0.03
1.25	ABB 1.25%/11-11.10.2016	3 950 000			3 950 000	4 007 670.00	0.06
1.5	ABB 1.5%/12-23.11.2018	4 750 000			4 750 000	4 978 000.00	0.08
2.25	ABB 2.25%/11-11.10.2021	12 290 000	250 000	160 000	12 380 000	13 847 030.00	0.22
1.875	ADECCO 1.875%/12-18.12.2017	1 000 000			1 000 000	1 038 000.00	0.02
2.125	ADECCO 2.125%/12-08.02.2016	1 575 000		1 575 000			
2.625	ADECCO 2.625%/12-18.12.2020	3 560 000			3 560 000	4 010 340.00	0.06
1.125	ADUNO HOLDING 1.125%/14-16.07.2021	1 250 000	50 000		1 300 000	1 373 450.00	0.02
2.25	ADUNO HOLDING 2.25%/11-27.10.2017	2 115 000	250 000		2 365 000	2 478 520.00	0.04
0.75	ALLREAL HOLDING 0.75%/15-31.03.2021				520 000	529 620.00	0.01
1.375	ALLREAL HOLDING 1.375%/15-31.03.2025		1 000 000		1 000 000	1 042 000.00	0.02
2.5	ALLREAL HOLDING 2.5%/11-12.05.2016	340 000			340 000	345 508.00	0.01
2	ALLREAL HOLDING LTD 2%/13-23.09.2020	3 500 000	50 000		3 550 000	3 818 025.00	0.06
2.125	ALPIQ HOLDING 2.125%/15-30.06.2023		50 000		50 000	49 950.00	0.00
2.25	ALPIQ HOLDING 2.25%/11-20.09.2021	1 500 000		90 000	1 410 000	1 434 675.00	0.02
2.625	ALPIQ HOLDING 2.625%/06-01.03.2018	2 325 000		1 895 000	430 000	445 050.00	0.01
2.625	ALPIQ HOLDING 2.625%/14-29.07.2024	3 000 000	800 000		3 800 000	3 851 300.00	0.06
3	ALPIQ HOLDING 3%/09-25.11.2019	6 645 000	250 000	2 595 000	4 300 000	4 547 250.00	0.07
3	ALPIQ HOLDING 3%/12-16.05.2022	4 650 000	1 140 000		5 790 000	6 143 190.00	0.10
3.875	ALPIQ HOLDING 3.875%/08-30.10.2018	1 710 000		990 000	720 000	779 400.00	0.01
2.625	AXPO HOLDING 2.625%/10-26.02.2020	10 440 000	1 250 000	200 000	11 490 000	12 639 000.00	0.20
3.125	AXPO HOLDING 3.125%/10-26.02.2025	4 350 000	510 000	110 000	4 750 000	5 633 500.00	0.09
1	BALOISE-HOLDING 1%/12-12.10.2017	1 550 000			1 550 000	1 582 550.00	0.02
1.125	BALOISE-HOLDING 1.125%/14-19.12.2024	1 500 000	250 000		1 750 000	1 813 875.00	0.03
1.75	BALOISE-HOLDING 1.75%/13-26.04.2023	4 100 000			4 100 000	4 454 650.00	0.07
2	BALOISE-HOLDING 2%/12-12.10.2022	1 000 000			1 000 000	1 102 500.00	0.02
2.25	BALOISE-HOLDING 2.25%/12-01.03.2019	2 620 000	250 000		2 870 000	3 085 250.00	0.05
2.875	BALOISE-HOLDING 2.875%/10-14.10.2020	7 000 000	250 000		7 250 000	8 214 250.00	0.13
3	BALOISEOLDING 3%/11-07.07.2021	1 250 000	100 000		1 350 000	1 556 550.00	0.02
1	BANK J. SAFRA SARASIN 1%/14-28.05.2020	2 000 000			2 000 000	2 086 000.00	0.03
2.25	BANQUE CANTONALE DE FRIBOURG 2.25%/11-14.06.2021	2 000 000			2 000 000	2 259 000.00	0.04
0.5	BANQUE CANTONALE DE GENEVE (subordinated) 3.5%/04-		2 500 000		2 500 000	2 523 750.00	0.04
3.125	BANQUE CANTONALE DE GENEVE 3.125%/11-07.11.2018	500 000			500 000	541 500.00	0.01
0.625	BANQUE CANTONALE DU JURA 0.625%/15-04.03.2025		75 000		75 000	75 900.00	0.00
1.25	BANQUE CANTONALE NEUCHATELOISE 1.25%/12-26.04.2021	500 000	50 000		550 000	586 025.00	0.01
1.5	BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.5%/14-28.03.2024	1 500 000	700 000		2 200 000	2 421 100.00	0.04
1.625	BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.625%/11-30.11.2026	410 000			410 000	459 610.00	0.01
2.5	BANQUE CANTONALE VAUDOISE 2.5%/10-25.03.2020	2 890 000		160 000	2 730 000	3 065 790.00	0.05
0.625	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.625%/12-27.02.	1 570 000	3 000 000		4 570 000	4 670 540.00	0.07
0.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.75%/15-30.03.2		7 390 000		7 390 000	7 578 445.00	0.12
1	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1%/12-04.10.2022	4 800 000	2 000 000		6 800 000	7 228 400.00	0.11
1.125	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.125%/13-27.03.	2 500 000	1 500 000		4 000 000	4 292 000.00	0.07
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/10-09.11.2	3 630 000			3 630 000	3 965 775.00	0.06
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/10-25.06.2	1 100 000			1 250 000	1 340 000.00	0.02
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/11-22.11.2	9 960 000	175 000		10 135 000	11 447 482.50	0.18
2.5	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 2.5%/09-16.12.20	1 850 000	1 000 000		2 850 000	3 173 475.00	0.05
3	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 3%/07-14.12.2017	3 155 000			3 155 000	3 394 780.00	0.05
1.5	BASLER KANTONALBANK 1.5%/10-26.10.2018	700 000			700 000	738 500.00	0.01
1.5	BASLER KANTONALBANK 1.5%/12-02.03.2027	1 530 000			1 530 000	1 699 065.00	0.03
1.875	BASLER KANTONALBANK 1.875%/10-26.10.2026	2 250 000			2 250 000	2 596 500.00	0.04
2.5	BASLER KANTONALBANK 2.5%/06-24.03.2021	6 555 000	300 000		6 855 000	7 818 127.50	0.12
2.75	BASLER KANTONALBANK 2.75%/04-22.12.2016	7 445 000			7 445 000	7 745 033.50	0.12
3.25	BASLER KANTONALBANK 3.25%/07-29.06.2022	3 760 000			3 760 000	4 572 160.00	0.07
1	BELL 1%/13-16.05.2018	2 390 000			2 390 000	2 448 555.00	0.04
1.75	BELL 1.75%/13-16.05.2022	1 275 000	50 000		1 325 000	1 445 575.00	0.02
2.875	BERNER KANTONALBANK 2.875%/04-22.04.2016	1 970 000			1 970 000	2 011 370.00	0.03
1.875	BKW 1.875%/10-15.10.2018	100 000	1 000 000		1 100 000	1 157 750.00	0.02
2.5	BKW 2.5%/10-15.10.2030	1 000 000	850 000	120 000	1 730 000	1 982 580.00	0.03
3	BKW 3%/07-27.04.2022	2 280 000	140 000		2 420 000	2 805 990.00	0.04
3.375	BKW 3.375%/09-29.07.2019	9 000 000		140 000	8 860 000	9 954 210.00	0.16
0.625	BUCHER INDUSTRIES 0.625%/14-02.10.2020	1 000 000			1 000 000	1 018 000.00	0.02
1.375	BUCHER INDUSTRIES 1.375%/14-02.10.2024	1 000 000			1 000 000	1 045 000.00	0.02
1.25	CANTON DE NEUCHÂTEL 1.25%/12-24.09.2027	3 250 000	2 000 000		5 250 000	5 767 125.00	0.09
0.625	CANTON OF GENEVA 0.625%/14-30.07.2021	350 000			350 000	365 225.00	0.01
1.25	CANTON OF GENEVA 1.25%/13-22.03.2023	2 000 000	100 000		2 100 000	2 290 050.00	0.04
1.625	CANTON OF GENEVA 1.625%/14-30.07.2029	1 500 000	100 000		1 600 000	1 823 200.00	0.03
2	CANTON OF GENEVA 2%/11-28.11.2041	500 000			500 000	631 750.00	0.01
1.75	CANTON OF ST. GALLEN 1.75%/13-18.07.2028	500 000			500 000	582 500.00	0.01
1.25	CANTON OF ZÜRICH 1.25%/13-29.07.2022	2 300 000			2 300 000	2 511 600.00	0.04

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.625	CANTON OF ZURICH 1.625%/13-29.07.2026	2 000 000	320 000		2 320 000	2 670 320.00	0.04
2	CANTON OF ZURICH 2%/13-29.07.2038	2 500 000			2 500 000	3 201 250.00	0.05
1.25	CANTONE TICINO 1.25%/12-11.06.2027	500 000			500 000	542 000.00	0.01
0.75	CEMBRA MONEY BANK 0.75%/14-14.10.2019	1 200 000			1 200 000	1 222 800.00	0.02
1.125	CEMBRA MONEY BANK 1.125%/13-29.11.2017	1 000 000	50 000	180 000	870 000	890 010.00	0.01
1.25	CEMBRA MONEY BANK 1.25%/14-14.10.2022	3 700 000	470 000		4 170 000	4 355 565.00	0.07
1.375	CHR FINANCE SWITZERLAND 1.375%/14-30.09.2022	4 400 000	5 250 000		9 650 000	10 007 050.00	0.16
0.5	CLIENTIS 0.5%/15-29.06.2022		2 500 000		2 500 000	2 493 750.00	0.04
1	CLIENTIS 1%/13-18.04.2018		250 000	250 000			
1.25	COOP GENOSSENSCHAFT 1.25%/12-25.07.2019	3 200 000	1 000 000		4 200 000	4 361 700.00	0.07
2	COOP GENOSSENSCHAFT 2%/10-29.09.2017	2 300 000			2 300 000	2 394 300.00	0.04
2	COOP GENOSSENSCHAFT 2%/10-30.06.2016	6 080 000			6 080 000	6 179 104.00	0.10
3.25	COOP GENOSSENSCHAFT 3.25%/09-31.07.2015	1 390 000		1 390 000			
0.875	COOP-GRUPPE 0.875%/14-16.06.2021	2 000 000	100 000		2 100 000	2 172 450.00	0.03
1	COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 1%/14-29.09.2023	2 000 000			2 000 000	2 073 000.00	0.03
0.75	CREDIT SUISSE 0.75%/14-11.07.2019	2 000 000	50 000		2 050 000	2 100 225.00	0.03
2.375	CREDIT SUISSE 2.375%/10-21.06.2017	6 090 000	250 000		6 340 000	6 593 600.00	0.10
3.375	CREDIT SUISSE 3.375%/10-16.03.2020	3 050 000	1 640 000		4 690 000	5 264 525.00	0.08
2.5	EGL 2.5%/05-23.11.2015	3 520 000		3 520 000			
1.25	EGW S. 43 1.25%/12-15.06.2027	3 920 000			3 920 000	4 339 440.00	0.07
1	ELSEVIER FINANCE 1%/13-18.12.2018	2 000 000	100 000		2 100 000	2 143 050.00	0.03
0.875	EMISSIONSTZ EGW S. 44 0.875%/12-24.03.2023	2 100 000	300 000		2 400 000	2 557 200.00	0.04
1.75	EMISSIONSZ EGW S. 42 1.75%/11-14.09.2026	1 300 000			1 300 000	1 513 850.00	0.02
2.5	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 36 2.5%/09-27.11.2019	450 000			450 000	503 550.00	0.01
0.125	EMISSIONSZENTRALE EGW S. -51- 0.125%/15-27.05.2025		200 000		200 000	198 900.00	0.00
0.375	EMISSIONSZENTRALE EGW S. -52- 0.375%/15-27.05.2030		6 500 000		6 500 000	6 396 000.00	0.10
2.75	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 24 2.75%/05-30.04.2020	1 950 000			1 950 000	2 224 950.00	0.03
2.25	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 25 2.25%/05-19.09.2017	2 450 000			2 450 000	2 587 200.00	0.04
3.125	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 32 3.125%/07-12.12.2016	2 000 000			2 000 000	2 092 800.00	0.03
3.5	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 33 3.5%/08-18.05.2018	1 000 000			1 000 000	1 107 000.00	0.02
1.75	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 39 1.75%/10-04.11.2020	150 000			150 000	165 225.00	0.00
1.375	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 45 1.375%/13-27.03.2028	4 100 000			4 100 000	4 608 400.00	0.07
1.625	EMMI FINANZ 1.625%/13-12.07.2023	2 050 000	185 000	80 000	2 155 000	2 325 245.00	0.04
2.125	EMMI FINANZ 2.125%/11-30.06.2017	5 325 000			5 325 000	5 527 350.00	0.09
1	ENAG ENERGIEFINANZIERUNGS 1%/13-14.12.2018	550 000			550 000	559 625.00	0.01
2.625	ENAG ENERGIEFINANZIERUNGS 2.625%/11-31.01.2023	3 500 000	50 000	100 000	3 450 000	3 788 100.00	0.06
0.125	ENGADINER KRAFTWERKE 0.125%/15-02.03.2022	1 500 000			1 500 000	1 479 000.00	0.02
1.625	ENGADINER KRAFTWERKE 1.625%/14-25.04.2024	1 000 000	50 000		1 050 000	1 130 850.00	0.02
2.75	ENGADINER KRAFTWERKE 2.75%/06-10.10.2016	255 000			255 000	262 420.50	0.00
0.625	EUROFIMA BASEL 0.625%/14-30.06.2021	2 500 000			2 500 000	2 595 000.00	0.04
2.125	EUROFIMA BASEL 2.125%/09-10.11.2017	1 725 000	150 000		1 875 000	1 978 125.00	0.03
2.25	EUROFIMA BASEL 2.25%/05-15.06.2016	10 420 000		5 000 000	5 420 000	5 532 194.00	0.09
2.375	EUROFIMA BASEL 2.375%/05-03.08.2020	6 600 000	100 000		6 700 000	7 527 450.00	0.12
2.875	EUROFIMA BASEL 2.875%/05-04.02.2030	3 850 000	1 050 000		4 900 000	6 423 900.00	0.10
3	EUROFIMA BASEL 3%/06-15.05.2026	13 515 000	250 000		13 765 000	17 502 197.50	0.27
3	EUROFIMA BASEL 3%/07-22.05.2024	9 050 000	500 000		9 550 000	11 827 675.00	0.18
3.25	EUROFIMA BASEL 3.25%/03-28.12.2018	8 840 000			8 840 000	9 883 120.00	0.15
3.375	EUROFIMA BASEL 3.375%/04-29.12.2020	1 375 000			1 375 000	1 628 687.50	0.03
2	FEDERATION OF MIGROS COOPERATIVES 2%/11-03.05.2017	1 950 000			1 950 000	2 026 050.00	0.03
1.5	FIDIS FINANCE 1.5%/14-25.07.2017	1 500 000			1 500 000	1 520 250.00	0.02
1.25	FLUGHAFEN ZUERICH 1.25%/12-03.07.2020	2 730 000			2 730 000	2 886 975.00	0.05
1.5	FLUGHAFEN ZUERICH 1.5%/13-17.04.2023	6 750 000			6 750 000	7 306 875.00	0.11
2.25	FLUGHAFEN ZUERICH 2.25%/11-05.05.2017	1 830 000			1 830 000	1 901 370.00	0.03
0.55	FREIBURGER KANTONALBANK 0.55%/15-03.02.2025	500 000	400 000		900 000	915 300.00	0.01
0.6	FREIBURGER KANTONALBANK 0.6%/15-09.04.2027		3 500 000		3 500 000	3 522 750.00	0.05
1.125	FREIBURGER KANTONALBANK 1.125%/12-01.02.2022	2 040 000	1 500 000		3 540 000	3 777 180.00	0.06
1.125	FREIBURGER KANTONALBANK 1.125%/13-28.03.2023	3 000 000	250 000		3 250 000	3 482 375.00	0.05
1.125	FREIBURGER KANTONALBANK 1.125%/14-05.02.2021	2 000 000			2 000 000	2 128 000.00	0.03
1.25	FREIBURGER KANTONALBANK 1.25%/14-03.06.2024	5 000 000	100 000		5 100 000	5 518 200.00	0.09
1.375	FREIBURGER KANTONALBANK 1.375%/11-23.02.2016	410 000			410 000	413 526.00	0.01
1.45	FREIBURGER KANTONALBANK 1.45%/12-07.06.2027	2 100 000			2 100 000	2 317 350.00	0.04
1.875	FREIBURGER KANTONALBANK 1.875%/10-17.02.2017	3 425 000			3 425 000	3 531 175.00	0.06
2.5	GALENICA 2.5%/10-27.10.2017	3 140 000		120 000	3 020 000	3 157 410.00	0.05
0.05	GEBERIT 0.05%/15-17.04.2019		400 000		400 000	400 000.00	0.01
0.3	GEBERIT 0.3%/15-17.04.2023		1 950 000		1 950 000	1 960 725.00	0.03
3.375	GEORG FISCHER 3.375%/10-12.05.2016	1 030 000			1 030 000	1 053 175.00	0.02
1.5	GEORG FISCHER FINANZ 1.5%/13-12.09.2018	430 000			430 000	443 975.00	0.01
2.5	GEORG FISCHER FINANZ 2.5%/13-12.09.2022	1 500 000	50 000		1 550 000	1 687 950.00	0.03
1	GIVAUDAN 1%/14-18.09.2020	500 000	40 000		540 000	565 380.00	0.01
1.25	GIVAUDAN 1.25%/11-07.12.2016	2 165 000			2 165 000	2 197 691.50	0.03
1.75	GIVAUDAN 1.75%/14-19.03.2024	2 000 000			2 000 000	2 219 000.00	0.03
2.125	GIVAUDAN 2.125%/11-07.12.2021	1 920 000	200 000		2 120 000	2 383 940.00	0.04
2.5	GIVAUDAN 2.5%/11-15.06.2018	4 680 000			4 680 000	5 016 960.00	0.08
1	GLARNER KANTONALBANK 1%/12-21.09.2022	1 500 000			1 500 000	1 587 750.00	0.02
1	GLARNER KANTONALBANK 1%/13-04.10.2019	250 000			250 000	260 375.00	0.00
1.375	GRANDE DIXENCE 1.375%/15-18.02.2025	1 000 000			1 000 000	1 020 000.00	0.02
2.375	GRANDE DIXENCE 2.375%/11-10.06.2021	1 000 000			1 000 000	1 080 500.00	0.02
3.375	GRANDE DIXENCE 3.375%/07-27.09.2017	3 000 000			3 000 000	3 175 500.00	0.05
0.625	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.625%/15-20.04.2029		5 650 000		5 650 000	5 635 875.00	0.09
1.375	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 1.375%/13-11.03.2025	5 500 000	400 000		5 900 000	6 481 150.00	0.10
2	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 2%/10-08.02.2017	2 310 000			2 310 000	2 386 230.00	0.04
1.5	HELVETIA SWISS INSURANCE 1.5%/14-28.04.2025		460 000		460 000	497 490.00	0.01
0.75	HELVETIA SWISS INSURANCE COMPANY 0.75%/14-28.10.20	500 000			500 000	514 250.00	0.01
2	HOLCIM 2%/13-09.06.2022	2 075 000	50 000	120 000	2 005 000	2 192 467.50	0.03
2.375	HOLCIM 2.375%/10-07.06.2016	4 740 000			4 740 000	4 817 262.00	0.08
3	HOLCIM 3%/12-22.11.2022	6 200 000		150 000	6 050 000	7 072 450.00	0.11
3.125	HOLCIM 3.125%/07-20.02.2017	3 395 000			3 395 000	3 537 590.00	0.06
4	HOLCIM 4%/09-11.09.2018	6 800 000	50 000		6 850 000	7 624 050.00	0.12
1.625	IMPLENIA 1.625%/14-15.10.2024	1 200 000			1 250 000	1 290 625.00	0.02
3.125	IMPLENIA 3.125%/10-12.05.2016	1 710 000		1 400 000	310 000	316 665.00	0.00
2	KANTON AARGAU 2%/10-15.12.2028	2 870 000			2 870 000	3 444 000.00	0.05
0.125	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.125%/15-26.02.2026	2 500 000	395 000		2 895 000	2 866 050.00	0.04

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
0.25	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.25%/15-24.06.2024		990 000		990 000	1 002 870.00	0.02
0.5	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.5%/14-30.03.2022	3 100 000	2 240 000		5 340 000	5 550 930.00	0.09
0.5	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.5%/15-23.02.2035	1 600 000		600 000	1 000 000	971 000.00	0.02
1	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1%/14-30.03.2027	4 500 000			4 500 000	4 833 000.00	0.08
1.375	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1.375%/14-29.09.2034	5 200 000	3 000 000		8 200 000	9 249 600.00	0.14
1.5	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 1.5%/13-26.06.2028	2 700 000			2 700 000	3 057 750.00	0.05
2.625	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 2.625%/11-10.05.2029	300 000			300 000	385 650.00	0.01
0.125	KANTON BASEL-STADT 0.125%/12-29.08.2017	980 000			980 000	990 290.00	0.02
0.5	KANTON BASEL-STADT 0.5%/13-28.11.2018	8 000 000			7 500 000	7 706 250.00	0.12
1.875	KANTON BASEL-STADT 1.875%/10-31.05.2019	7 610 000		500 000	7 110 000	7 700 130.00	0.12
3.25	KANTON BASEL-STADT 3.25%/08-31.01.2020	4 930 000			4 930 000	5 696 615.00	0.09
1.75	KANTON BASELLANDSCHAFT 1.75%/13-26.06.2043	3 300 000			3 300 000	4 095 300.00	0.06
2.625	KANTON BASELLANDSCHAFT 2.625%/11-10.05.2030	500 000			500 000	650 500.00	0.01
0.625	KANTON BERN 0.625%/15-11.02.2032	2 000 000			2 000 000	2 046 000.00	0.03
1	KANTON BERN 1%/12-25.10.2024	2 840 000			2 840 000	3 051 580.00	0.05
1.25	KANTON BERN 1.25%/12-30.03.2027	3 440 000			3 440 000	3 785 720.00	0.06
1.25	KANTON BERN 1.25%/13-07.02.2028	5 000 000			5 000 000	5 502 500.00	0.09
1.25	KANTON BERN 1.25%/13-20.09.2021	2 000 000	450 000		2 450 000	2 655 800.00	0.04
1.25	KANTON BERN 1.25%/14-12.09.2030	1 000 000			1 000 000	1 102 000.00	0.02
1.25	KANTON BERN 1.25%/14-22.04.2024	2 000 000			2 000 000	2 193 000.00	0.03
1.5	KANTON BERN 1.5%/13-15.05.2029	3 660 000	100 000		3 760 000	4 275 120.00	0.07
1.75	KANTON BERN 1.75%/10-24.09.2025	1 850 000			1 850 000	2 131 200.00	0.03
2.25	KANTON BERN 2.25%/10-31.05.2023	5 735 000			5 735 000	6 709 950.00	0.10
2.25	KANTON BERN 2.25%/11-20.04.2026	2 250 000			2 250 000	2 723 625.00	0.04
2.375	KANTON BERN 2.375%/10-25.03.2022	6 070 000			6 070 000	7 047 270.00	0.11
2.5	KANTON BERN 2.5%/09-26.11.2021	50 000	1 000 000		1 050 000	1 220 100.00	0.02
2.625	KANTON BERN 2.625%/09-24.04.2020	2 490 000	1 000 000		3 490 000	3 954 170.00	0.06
3.125	KANTON BERN 3.125%/07-27.06.2019	2 470 000	1 500 000		3 970 000	4 498 010.00	0.07
1	KANTON GENÈVE 1%/12-26.10.2022	4 500 000	460 000		4 960 000	5 304 720.00	0.08
1.25	KANTON GENÈVE 1.25%/12-26.10.2026	7 690 000			7 690 000	8 439 775.00	0.13
1.25	KANTON GENÈVE 1.25%/12-29.12.2022	4 000 000			4 000 000	4 362 000.00	0.07
1.375	KANTON GENÈVE 1.375%/14-25.09.2034	1 000 000			1 000 000	1 109 500.00	0.02
1.5	KANTON GENÈVE 1.5%/11-14.10.2024	1 750 000	500 000		2 250 000	2 515 500.00	0.04
1.5	KANTON GENÈVE 1.5%/12-05.03.2032	4 725 000			4 725 000	5 317 987.50	0.08
1.5	KANTON GENÈVE 1.5%/12-27.01.2028	1 550 000			1 550 000	1 737 550.00	0.03
1.5	KANTON GENÈVE 1.5%/12-28.05.2027	3 530 000			3 530 000	3 967 720.00	0.06
1.625	KANTON GENÈVE 1.625%/11-28.11.2023	4 390 000			4 390 000	4 932 165.00	0.08
1.75	KANTON GENÈVE 1.75%/13-22.03.2033	2 400 000			2 400 000	2 808 000.00	0.04
1.75	KANTON GENÈVE 1.75%/13-24.05.2034	4 400 000	500 000		4 900 000	5 757 500.00	0.09
2	KANTON GENÈVE 2%/13-20.03.2026	3 900 000	50 000		3 950 000	4 647 175.00	0.07
2.125	KANTON GENÈVE 2.125%/10-15.06.2020	4 450 000	300 000		4 750 000	5 274 875.00	0.08
2.125	KANTON GENÈVE 2.125%/10-27.10.2028	2 910 000			2 910 000	3 505 095.00	0.05
2.25	KANTON GENÈVE 2.25%/11-22.02.2021	6 030 000	200 000		6 230 000	7 039 900.00	0.11
2.25	KANTON GENÈVE 2.25%/13-20.09.2029	4 000 000			4 000 000	4 902 000.00	0.08
2.5	KANTON GENÈVE 2.5%/09-27.11.2019	2 750 000			2 750 000	3 073 125.00	0.05
2.5	KANTON GENÈVE 2.5%/10-06.04.2022	2 870 000	200 000		3 070 000	3 588 830.00	0.06
2	KANTON LUZERN 2%/13-28.10.2033	2 500 000			2 500 000	3 086 250.00	0.05
1.875	KANTON NEUCHÂTEAU 1.875%/09-10.11.2015	720 000		720 000			
0.375	KANTON OF SOLOTHURN 0.375%/14-15.12.2021	500 000			500 000	514 000.00	0.01
1	KANTON OF SOLOTHURN 1%/15-20.02.2045	3 000 000	1 600 000		4 600 000	4 889 800.00	0.08
1.25	KANTON OF ZÜRICH 1.25%/14-07.03.2024	3 000 000			3 000 000	3 300 000.00	0.05
0.375	KANTON SOLOTHURN 0.375%/12-29.11.2019	1 100 000			1 100 000	1 130 800.00	0.02
0.625	KANTON SOLOTHURN 0.625%/14-13.12.2024	3 500 000			3 500 000	3 645 250.00	0.06
1.125	KANTON SOLOTHURN 1.125%/12-29.11.2027	3 650 000			3 650 000	3 969 375.00	0.06
2	KANTON SOLOTHURN 2%/13-02.12.2038	800 000			800 000	1 012 400.00	0.02
2	KANTON SOLOTHURN 2%/13-02.12.2043	400 000			400 000	518 200.00	0.01
3.125	KANTON ST. GALLEN 3.125%/04-03.02.2020	2 880 000			2 880 000	3 314 880.00	0.05
3.75	KANTON ST. GALLEN 3.75%/98-09.04.2018	1 520 000			1 520 000	1 684 160.00	0.03
1.875	KANTON TESSIN (reg. -S-) 1.875%/13-18.03.2038	3 700 000			3 700 000	4 393 750.00	0.07
0.75	KANTON TESSIN 0.75%/12-11.06.2020	1 500 000			1 500 000	1 551 000.00	0.02
1.8	KANTON TESSIN 1.8%/13-15.05.2043	1 000 000			1 000 000	1 206 500.00	0.02
2.125	KANTON TESSIN 2.125%/10-24.11.2034	7 050 000			7 050 000	8 590 425.00	0.13
2.5	KANTON TESSIN 2.5%/05-09.02.2017	3 980 000			3 980 000	4 127 260.00	0.06
2.5	KANTON TESSIN 2.5%/06-31.10.2016	8 510 000			8 510 000	8 766 151.00	0.14
2.5	KANTON TESSIN 2.5%/09-04.11.2021	4 120 000			4 120 000	4 754 480.00	0.07
0.5	KANTON WAADT 0.5%/14-18.12.2024	6 000 000	100 000		6 100 000	6 276 900.00	0.10
1	KANTON WAADT 1%/12-07.06.2022	2 400 000			2 400 000	2 572 800.00	0.04
2	KANTON WAADT 2%/13-24.10.2033	8 500 000	3 000 000		11 500 000	14 196 750.00	0.22
0.375	KANTON ZÜRICH 0.375%/14-06.10.2021	1 500 000	200 000		1 700 000	1 760 350.00	0.03
0.5	KANTON ZÜRICH 0.5%/12-03.12.2020	5 360 000	300 000		5 660 000	5 889 230.00	0.09
1	KANTON ZÜRICH 1%/12-03.12.2025		240 000		240 000	260 040.00	0.00
1	KANTON ZÜRICH 1%/14-06.10.2027	2 000 000			2 000 000	2 170 000.00	0.03
1.25	KANTON ZÜRICH 1.25%/12-03.12.2032	6 160 000			6 160 000	6 819 120.00	0.11
2.375	KANTON ZÜRICH 2.375%/05-03.02.2016	9 415 000		9 415 000			
2.75	KANTON ZÜRICH 2.75%/04-24.11.2017	4 975 000			4 975 000	5 345 637.50	0.08
0.5	KANTON ZÜRICH 0.5%/13-06.06.2019	2 000 000			2 000 000	2 067 000.00	0.03
1.375	KANTON ZÜRICH 1.375%/13-06.12.2023	3 900 000	440 000		4 340 000	4 815 230.00	0.08
2	KERNKRAFTWERK GOESGEN-DAENIKEN 2%/13-30.09.2020	500 000			500 000	532 750.00	0.01
2	KERNKRAFTWERK LEIBSTADT 2%/10-29.03.2016	170 000	1 030 000	1 200 000			
2.5	KERNKRAFTWERK LEIBSTADT 2.5%/10-29.03.2019	2 150 000			2 150 000	2 287 600.00	0.04
2.375	KRAFTWERK AMSTEG 2.375%/06-09.03.2018	360 000			360 000	380 520.00	0.01
2.875	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN (KLL) 2.875%/11-30.06.203	1 830 000			1 830 000	2 175 870.00	0.03
2.125	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 2.125%/10-10.03.2017	1 060 000			1 060 000	1 092 860.00	0.02
2.375	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 2.375%/13-10.12.2026	500 000			500 000	563 000.00	0.01
2.75	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 2.75%/10-10.03.2022	1 515 000			1 515 000	1 731 645.00	0.03
3	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 3%/13-02.04.2048	2 000 000			2 000 000	2 580 000.00	0.04
3.375	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 3.375%/08-06.06.2016	180 000			180 000	184 410.00	0.00
2.75	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN(KLL) 2.75%/11-09.06.2023	4 330 000	100 000	210 000	4 220 000	4 865 660.00	0.08
2.875	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN (KLL) 2.875%/12-27.03.2042	4 570 000			4 570 000	5 618 815.00	0.09
3	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 3%/12-27.09.2052	2 250 000		90 000	2 160 000	2 800 440.00	0.04
1.875	KRAFTWERKE OBERHASLI 1.875%/13-21.02.2025	2 500 000			2 500 000	2 737 500.00	0.04
2.75	KRAFTWERKE OBERHASLI 2.75%/05-04.04.2017	290 000			290 000	301 890.00	0.00

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.5	KUONI REISEN HOLDINGS 1.5%/13-28.10.2019	2 500 000			2 500 000	2 531 250.00	0.04
1.25	KW LINTH-LIMMERN 1.25%/14-11.09.2024	3 150 000	250 000	220 000	3 180 000	3 262 680.00	0.05
0.5	LINDT & SPRUENGLI 0.5%/14-08.10.2020	5 500 000	3 150 000		8 650 000	8 861 925.00	0.14
1	LINDT & SPRUENGLI 1%/14-08.10.2024	2 200 000	520 000		2 720 000	2 847 840.00	0.04
3	LONZA GROUP 3%/10-02.06.2016	7 270 000			7 270 000	7 411 038.00	0.12
2	LONZA SWISS FINANCE 2%/12-11.10.2018	2 050 000			2 050 000	2 148 400.00	0.03
2.25	LONZA SWISS FINANCE 2.25%/11-07.12.2015	1 960 000		1 960 000			
1.75	LONZA SWISS FINANZ 1.75%/13-10.04.2019	3 200 000			3 200 000	3 321 600.00	0.05
3	LONZA SWISS FINANZ 3%/12-11.10.2022	4 600 000			4 600 000	5 129 000.00	0.08
3.125	LONZA SWISS FINANZ 3.125%/11-07.12.2018	1 150 000			1 150 000	1 244 875.00	0.02
2.375	LUZERNER KANTONALBANK 2.375%/09-10.09.2018	500 000			500 000	539 000.00	0.01
2.5	LUZERNER KANTONALBANK 2.5%/10-07.01.2022	3 500 000			3 500 000	4 035 500.00	0.06
0.375	LUZERNER KANTONALBANK 0.375%/15-30.01.2023		3 000 000		3 000 000	3 048 000.00	0.05
1.125	LUZERNER KANTONALBANK 1.125%/14-30.06.2023	3 000 000			3 000 000	3 216 000.00	0.05
1.625	LUZERNER KANTONALBANK 1.625%/12-20.07.2037	650 000			650 000	753 025.00	0.01
1.875	LUZERNER KANTONALBANK 1.875%/10-26.11.2035	3 550 000			3 550 000	4 222 725.00	0.07
1.875	LUZERNER KANTONALBANK 1.875%/10-30.06.2020	2 720 000	1 300 000		4 020 000	4 399 890.00	0.07
2	LUZERNER KANTONALBANK 2%/10-27.12.2039	1 700 000			1 700 000	2 101 200.00	0.03
2.125	LUZERNER KANTONALBANK 2.125%/11-04.10.2041	2 530 000			2 530 000	3 223 220.00	0.05
2.5	LUZERNER KANTONALBANK 2.5%/11-11.03.2043	500 000			500 000	689 750.00	0.01
2.625	LUZERNER KANTONALBANK 2.625%/05-25.11.2020	7 900 000	300 000		8 200 000	9 339 800.00	0.15
2.75	LUZERNER KANTONALBANK 2.75%/06-15.11.2016	2 975 000			2 975 000	3 084 777.50	0.05
3	LUZERNER KANTONALBANK 3%/05-11.03.2025	7 950 000	80 000		8 030 000	10 021 440.00	0.16
3	LUZERNER KANTONALBANK 3%/11-27.12.2021	1 280 000			1 280 000	1 463 680.00	0.02
3.375	LUZERNER KANTONALBANK 3.375%/07-05.07.2019	500 000			500 000	567 250.00	0.01
1.5	MOBIMO HOLDING 1.5%/13-29.10.2018	1 000 000			1 000 000	1 037 000.00	0.02
1.625	MOBIMO HOLDING 1.625%/14-19.05.2021	1 000 000	1 050 000	130 000	1 920 000	2 016 960.00	0.03
1.875	MOBIMO HOLDING 1.875%/14-16.09.2024	2 500 000	660 000		3 160 000	3 365 400.00	0.05
1.5	NANT DE DRANCE 1.50%/13-15.02.2021	2 050 000	200 000		2 250 000	2 374 875.00	0.04
2.375	NANT DE DRANCE 2.375%/13-15.02.2028	4 000 000		110 000	3 890 000	4 321 790.00	0.07
1.75	NAT DE DRANCE 1.75%/14-18.07.2024	3 300 000		110 000	3 190 000	3 430 845.00	0.05
0.25	NOVARTIS 0.25%/15-13.05.2025	4 250 000			4 250 000	4 205 375.00	0.07
0.625	NOVARTIS 0.625%/15-13.11.2029	7 750 000	650 000		8 400 000	8 303 400.00	0.13
1.05	NOVARTIS 1.05%/15-11.05.2035	4 700 000	2 300 000		7 000 000	7 091 000.00	0.11
1.25	OC OERLIKON CORP 1.25%/14-17.06.2019	4 100 000			4 100 000	4 173 800.00	0.07
2.625	OC OERLIKON CORP 2.625%/14-17.06.2024	1 750 000	300 000		2 050 000	2 289 850.00	0.04
4.25	OC OERLIKON CORP 4.25%/12-13.07.2016	1 000 000			1 000 000	1 032 900.00	0.02
2.125	PFANDBRIEF SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE S. 5	6 880 000			6 880 000	8 517 440.00	0.13
0.25	PFANDBRIEFBANK DER SCHWEIZERISCHER KANTONALBANKEN	500 000	800 000		1 300 000	1 324 700.00	0.02
0.375	PFANDBRIEFBANK S. 577 0.375%/12-13.07.2018	9 880 000	1 000 000	500 000	10 380 000	10 612 512.00	0.17
1	PFANDBRIEFBANK S. 595 1%/14-21.03.2023	5 700 000	250 000		5 950 000	6 356 980.00	0.10
1.5	PFANDBRIEFBANK S. 601 1.5%/14-09.11.2035		250 000		250 000	283 500.00	0.00
0.625	PFANDBRIEFBANK S. 603 0.625%/14-19.03.2025	2 000 000	4 000 000		6 000 000	6 202 200.00	0.10
0.375	PFANDBRIEFBANK S. 604 0.375%/15-21.01.2030	3 500 000	8 600 000		12 100 000	11 706 750.00	0.18
0.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPO S. 609 0.125%/15-04.12		3 250 000		3 250 000	3 243 500.00	0.05
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPO S. 610 0.625%/15-25.01		9 000 000		9 000 000	8 803 800.00	0.14
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -610	2 000 000		2 000 000			
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -613	4 500 000			4 500 000	4 599 900.00	0.07
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -614	2 000 000			2 000 000	2 091 600.00	0.03
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -615	2 000 000			2 000 000	2 112 000.00	0.03
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZ HYPOTHEKARINSTITUTE S. -616	2 000 000			2 000 000	2 009 000.00	0.03
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 000 000	2 320 000		7 320 000	7 843 380.00	0.12
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	9 005 000			9 005 000	9 247 234.50	0.14
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	9 875 000	200 000		10 075 000	11 550 987.50	0.18
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	12 160 000			12 160 000	14 430 272.00	0.23
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		3 200 000		3 200 000	3 144 000.00	0.05
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 000 000	100 000		2 100 000	2 352 840.00	0.04
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 545 000	300 000		2 845 000	3 179 287.50	0.05
0.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 000 000			3 000 000	3 040 500.00	0.05
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	12 050 000			12 050 000	15 078 165.00	0.24
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 000 000	100 000	500 000	2 600 000	2 651 220.00	0.04
2	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 275 000		500 000	2 775 000	3 028 635.00	0.05
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	9 150 000			9 150 000	10 449 300.00	0.16
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 820 000			1 820 000	2 014 558.00	0.03
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 000 000			8 000 000	8 532 800.00	0.13
2	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 420 000	3 940 000	7 000 000	2 360 000	2 403 660.00	0.04
3.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	13 775 000		400 000	13 375 000	14 761 987.50	0.23
1.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 350 000	700 000		7 050 000	8 058 855.00	0.13
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 650 000	300 000		8 950 000	9 737 600.00	0.15
3.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 390 000			7 390 000	9 145 864.00	0.14
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	20 435 000		500 000	19 935 000	21 505 878.00	0.34
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 830 000	300 000		6 130 000	6 537 645.00	0.10
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	14 420 000			14 420 000	19 138 224.00	0.30
0.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	13 470 000		500 000	12 970 000	13 560 135.00	0.21
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 400 000			4 400 000	5 797 880.00	0.09
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 200 000	1 000 000		5 200 000	6 417 320.00	0.10
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 500 000	1 800 000		10 300 000	11 387 680.00	0.18
1.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 490 000	300 000		6 790 000	7 447 272.00	0.12
2.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	900 000			900 000	1 154 610.00	0.02
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 610 000			8 610 000	10 362 135.00	0.16
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 930 000	1 250 000		3 180 000	3 421 998.00	0.05
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 000 000	1 550 000		3 550 000	3 923 460.00	0.06
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 000 000	670 000		7 670 000	8 186 191.00	0.13
3	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 560 000			7 560 000	8 032 500.00	0.13
0.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 000 000	1 850 000		3 850 000	3 989 755.00	0.06
2.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	17 620 000	200 000		17 820 000	21 189 762.00	0.33
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	9 680 000	300 000		9 980 000	10 643 670.00	0.17
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	18 210 000		500 000	17 710 000	18 560 080.00	0.29
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 565 000	860 000		6 425 000	6 946 067.50	0.11
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	10 850 000		400 000	10 450 000	11 693 550.00	0.18
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	9 500 000		5 000 000	4 500 000	4 549 050.00	0.07
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	15 220 000			15 220 000	15 633 984.00	0.24

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	10 415 000	300 000		10 715 000	11 905 436.50	0.19
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 040 000	300 000		5 340 000	6 290 520.00	0.10
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 930 000	350 000		6 280 000	6 661 196.00	0.10
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 000 000	1 940 000		8 940 000	9 751 752.00	0.15
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	13 700 000	750 000		14 450 000	15 749 055.00	0.25
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 200 000	100 000	1 500 000	3 800 000	3 914 000.00	0.06
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	18 200 000			18 200 000	20 327 580.00	0.32
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		4 000 000	4 000 000			
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 765 000	2 250 000		11 015 000	12 221 142.50	0.19
0.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		2 000 000		2 000 000	2 028 200.00	0.03
1.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 370 000		1 370 000			
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 300 000	620 000		2 920 000	3 518 308.00	0.05
1	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	12 000 000	1 150 000		13 150 000	13 970 560.00	0.22
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	15 580 000			15 580 000	18 043 198.00	0.28
2.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 500 000	1 000 000		6 500 000	8 199 100.00	0.13
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 950 000			1 950 000	1 979 250.00	0.03
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 540 000	250 000		7 790 000	7 959 043.00	0.12
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 875 000		400 000	6 475 000	7 185 955.00	0.11
1.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	12 100 000			12 100 000	14 316 720.00	0.22
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 500 000			6 500 000	7 161 050.00	0.11
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 000 000	1 000 000		9 000 000	9 020 700.00	0.14
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 970 000	400 000		6 370 000	7 057 960.00	0.11
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	7 500 000			7 500 000	8 478 750.00	0.13
0.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 000 000	2 000 000	1 500 000	4 500 000	4 565 250.00	0.07
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	14 580 000	630 000		15 210 000	17 042 805.00	0.27
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		3 845 000		3 845 000	3 873 837.50	0.06
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 000 000			2 000 000	2 056 400.00	0.03
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	12 435 000	425 000		12 860 000	14 576 810.00	0.23
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	10 685 000			10 685 000	11 329 305.50	0.18
2.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	16 185 000	300 000		16 485 000	18 926 428.50	0.30
0.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 380 000			5 380 000	5 435 952.00	0.08
2.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 000 000			3 000 000	3 881 400.00	0.06
1.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	6 700 000	150 000		6 850 000	7 672 685.00	0.12
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 710 000			4 710 000	4 922 421.00	0.08
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	10 020 000			10 020 000	12 284 520.00	0.19
2.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	8 430 000		400 000	8 030 000	8 945 420.00	0.14
0.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	900 000		900 000			
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 780 000			4 780 000	4 822 542.00	0.08
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		1 455 000	1 455 000			
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 635 000			5 635 000	5 717 271.00	0.09
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 755 000			3 755 000	3 902 196.00	0.06
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANK	9 150 000	50 000		9 200 000	9 922 200.00	0.15
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANK	5 100 000	300 000		5 400 000	5 703 480.00	0.09
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANK	14 100 000	250 000		14 350 000	15 107 680.00	0.24
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 100 000	300 000		5 400 000	5 974 560.00	0.09
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	750 000			750 000	755 325.00	0.01
2.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 150 000		400 000	6 750 000	7 408 125.00	0.12
2.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 270 000			6 270 000	7 285 740.00	0.11
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 450 000			1 450 000	1 477 840.00	0.02
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 550 000	1 050 000		10 600 000	11 549 760.00	0.18
2.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 080 000	1 100 000	400 000	5 780 000	6 363 780.00	0.10
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 950 000	50 000		5 000 000	5 647 500.00	0.09
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	8 970 000	700 000		9 670 000	10 472 610.00	0.16
1	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 400 000	1 875 000		11 275 000	12 040 572.50	0.19
2.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	12 580 000		12 000 000	580 000	590 208.00	0.01
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 680 000			9 680 000	10 711 888.00	0.17
2.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	8 250 000	800 000		9 050 000	10 561 350.00	0.16
2.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	500 000			500 000	582 450.00	0.01
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 900 000			6 900 000	7 008 330.00	0.11
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 810 000			5 810 000	6 117 349.00	0.10
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 650 000	200 000		5 850 000	6 470 100.00	0.10
3	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 580 000			9 580 000	10 389 510.00	0.16
3.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 560 000			7 560 000	8 387 820.00	0.13
2	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 370 000			9 370 000	9 927 515.00	0.15
0.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		3 300 000		3 300 000	3 382 500.00	0.05
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 030 000	150 000		4 180 000	4 711 278.00	0.07
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 335 000	3 375 000	500 000	6 210 000	6 362 145.00	0.10
2.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 850 000			6 850 000	7 102 080.00	0.11
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		1 800 000		1 800 000	1 763 820.00	0.03
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	8 040 000			8 040 000	9 135 048.00	0.14
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	460 000	50 000		510 000	541 467.00	0.01
2.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 250 000	700 000	1 950 000			
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 500 000	450 000		5 950 000	6 583 675.00	0.10
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 000 000	300 000		7 300 000	8 386 240.00	0.13
2	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 700 000	75 000		9 775 000	11 456 300.00	0.18
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 600 000			2 600 000	2 839 200.00	0.04
0.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		3 500 000		3 500 000	3 505 950.00	0.05
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	710 000			710 000	715 609.00	0.01
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	10 745 000	300 000		11 045 000	11 989 347.50	0.19
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	230 000	500 000		730 000	751 243.00	0.01
1	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 000 000	475 000		7 475 000	7 990 775.00	0.12
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 200 000	2 000 000		7 200 000	8 088 480.00	0.13
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 000 000	200 000		4 200 000	4 569 600.00	0.07
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	250 000	500 000		750 000	818 775.00	0.01
0.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 500 000	4 000 000		7 500 000	7 869 000.00	0.12
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 940 000		500 000	6 440 000	6 984 180.00	0.11
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	12 945 000			12 945 000	13 404 547.50	0.21
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		5 000 000		5 000 000	5 106 500.00	0.08
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 550 000			9 550 000	10 440 060.00	0.16
3.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	10 520 000		400 000	10 120 000	11 562 100.00	0.18
0.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 000 000	500 000		9 500 000	9 951 250.00	0.16
2.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	9 070 000			9 070 000	9 499 918.00	0.15

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	23 900 000	400 000		24 300 000	26 302 320.00	0.41
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 840 000	100 000		2 940 000	3 371 886.00	0.05
2.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 600 000	2 000 000	400 000	3 200 000	3 549 440.00	0.06
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 410 000			7 410 000	7 639 710.00	0.12
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	7 550 000	2 750 000	500 000	9 800 000	10 192 000.00	0.16
3.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 670 000			1 670 000	1 792 745.00	0.03
0.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		5 100 000		5 100 000	5 219 850.00	0.08
0.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	590 000			590 000	598 024.00	0.01
2.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	6 040 000			6 040 000	7 332 560.00	0.11
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE S. 428 0.875%/12-20.06.2022	9 700 000	3 120 000		12 820 000	13 595 610.00	0.21
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 429 1.375%/13-05.11.2027	9 280 000	500 000		9 780 000	10 817 658.00	0.17
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE S. 433 1.5%/13-21.06.2028		300 000		300 000	336 450.00	0.01
0.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 439 0.375%/13-31.10.2017	5 950 000			5 950 000	6 055 910.00	0.09
1.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 440 1.25%/13-29.10.2021	4 790 000	650 000		5 440 000	5 872 480.00	0.09
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 441 0.25%/13-01.12.2017	900 000			900 000	913 500.00	0.01
1.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 442 1.375%/13-12.12.2022	6 000 000	200 000		6 200 000	6 797 060.00	0.11
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 443 0.25%/14-28.03.2018	1 400 000			1 400 000	1 422 820.00	0.02
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE S. 445 1.625%/14-17.06.2026	8 150 000	1 000 000		9 150 000	10 377 930.00	0.16
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE S. 458 0.5%/14-20.10.2023	7 000 000			7 000 000	7 203 700.00	0.11
1	PFANDBRIEFZENTRALE S. 459 1%/14-22.09.2028	17 000 000	500 000		17 500 000	18 541 250.00	0.29
0.375	PFANDBRIEFZENTRALE S.461 0.375%/15-14.02.2025		3 250 000		3 250 000	3 289 000.00	0.05
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE s 446 0.25%/14-21.06.2018	4 220 000		500 000	3 720 000	3 786 960.00	0.06
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE s 447 0.875%/14-10.06.2021	8 500 000	50 000		8 550 000	9 013 410.00	0.14
1	PSP SWISS PROPERTY 1%/13-08.02.2019	2 000 000			2 000 000	2 060 000.00	0.03
1	PSP SWISS PROPERTY 1%/15-06.02.2025	450 000			450 000	456 300.00	0.01
1.375	PSP SWISS PROPERTY 1.375%/14-04.02.2020	1 500 000	150 000	130 000	1 520 000	1 586 880.00	0.02
2.625	PSP SWISS PROPERTY 2.625%/06-16.02.2016	2 650 000		2 650 000			
1.375	RAIFFEISEN SCHWEIZ 1.375%/10-21.09.2017	1 600 000			1 600 000	1 652 800.00	0.03
2	RAIFFEISEN SCHWEIZ 2%/10-21.09.2023	8 050 000	50 000		8 100 000	9 177 300.00	0.14
2.125	RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.125%/11-04.02.2019	5 440 000			5 440 000	5 839 840.00	0.09
2.375	RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.375%/11-10.05.2018	450 000	100 000		550 000	586 850.00	0.01
2.625	RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.625%/11-04.02.2026	3 700 000			3 700 000	4 499 200.00	0.07
3.125	RAIFFEISEN SCHWEIZ 3.125%/06-30.05.2016	9 040 000			9 040 000	9 267 808.00	0.14
3.875	RAIFFEISEN SCHWEIZ 3.875%/11-21.12.2021	4 600 000		220 000	4 380 000	5 076 420.00	0.08
2.375	REPOWER 2.375%/10-20.07.2022	3 300 000	810 000		4 110 000	4 083 285.00	0.06
2.5	REPOWER 2.5%/09-18.11.2016	500 000			500 000	503 750.00	0.01
1	ROCHE KAPITALMARKT 1%/12-21.09.2018	3 785 000	1 750 000		5 535 000	5 728 725.00	0.09
1.625	ROCHE KAPITALMARKT 1.625%/12-23.09.2022	5 140 000		160 000	4 980 000	5 485 470.00	0.09
4.5	ROCHE KAPITALMARKT 4.5%/09-23.03.2017	21 970 000			21 970 000	23 617 750.00	0.37
0.375	SCHAFFHAUSER KANTONALBANK 0.375%/15-16.02.2027	2 500 000	500 000		3 000 000	2 985 000.00	0.05
1.125	SCHAFFHAUSER KANTONALBANK 1.125%/13-24.04.2023	1 425 000			1 425 000	1 527 600.00	0.02
1.75	SCHAFFHAUSER KB 1.75%/13-28.10.2025	800 000			800 000	906 400.00	0.01
1.25	SCHINDLER HOLDING 1.25%/11-21.11.2016	6 490 000		110 000	6 380 000	6 468 682.00	0.10
0.75	SCHWYZER KANTONALBANK 0.75%/1-12.03.2020	500 000			500 000	519 250.00	0.01
0.75	SCHWYZER KANTONALBANK 0.75%/12-05.10.2020	2 000 000	250 000		2 250 000	2 342 250.00	0.04
1.125	SCHWYZER KANTONALBANK 1.125%/13-20.02.2023	2 300 000	2 120 000		4 420 000	4 738 240.00	0.07
1.375	SCHWYZER KANTONALBANK 1.375%/13-24.09.2021	3 780 000			3 780 000	4 084 290.00	0.06
1.5	SCHWYZER KANTONALBANK 1.5%/11-10.02.2017	3 310 000			3 310 000	3 394 405.00	0.05
1.625	SCHWYZER KANTONALBANK 1.625%/10-25.05.2016	1 780 000	300 000		2 080 000	2 110 576.00	0.03
0.25	SGS 0.25%/15-08.05.2023		3 500 000		3 500 000	3 472 000.00	0.05
0.875	SGS 0.875%/15-08.05.2030		3 710 000		3 710 000	3 646 930.00	0.06
1.375	SGS 1.375%/14-25.02.2022	3 422 000			3 422 000	3 652 985.00	0.06
1.75	SGS 1.75%/14-27.02.2024	3 250 000	2 300 000		5 550 000	6 102 225.00	0.10
1.875	SGS 1.875%/10-19.08.2016	955 000			955 000	971 521.50	0.02
2.625	SGS 2.625%/11-08.03.2019	6 790 000	150 000	130 000	6 810 000	7 409 280.00	0.12
3	SGS 3%/11-27.05.2021	3 110 000	50 000	110 000	3 050 000	3 522 750.00	0.05
1	SIKA 1%/12-12.07.2018	1 500 000	150 000		1 650 000	1 692 075.00	0.03
1.125	SIKA 1.125%/13-14.11.2019	2 550 000	250 000		2 800 000	2 916 200.00	0.05
1.75	SIKA 1.75%/12-12.07.2022	1 250 000	460 000		1 710 000	1 859 625.00	0.03
1.875	SIKA 1.875%/13-14.11.2023	2 000 000		100 000	1 900 000	2 093 800.00	0.03
2.875	SIKA 2.875%/06-23.03.2016	150 000	590 000		740 000	752 358.00	0.01
0.25	ST. GALLER KANTONALBANK 0.25%/15-28.01.2021	4 000 000			4 000 000	4 056 000.00	0.06
0.5	ST. GALLER KANTONALBANK 0.5%/15-24.06.2025		1 500 000		1 500 000	1 516 500.00	0.02
0.625	ST. GALLER KANTONALBANK 0.625%/14-09.09.2022	3 000 000	1 945 000		4 945 000	5 110 657.50	0.08
1.5	ST. GALLER KANTONALBANK 1.5%/13-13.09.2022	3 000 000			3 000 000	3 283 500.00	0.05
2.5	ST. GALLER KANTONALBANK 2.5%/05-30.11.2017	7 810 000			7 810 000	8 294 220.00	0.13
2.25	ST.GALLER KANTONALBANK 2.25%/10-11.05.2020	2 150 000			2 150 000	2 388 650.00	0.04
2.5	ST.GALLER KANTONALBANK 2.5%/06-12.12.2018	1 280 000			1 280 000	1 394 560.00	0.02
1.375	ST.GALLER KANTONALBANK 1.375%/12-22.06.2027	2 300 000	95 000		2 395 000	2 617 735.00	0.04
1.5	ST.GALLER KANTONALBANK 1.5%/13-12.02.2031	2 000 000			2 000 000	2 222 000.00	0.03
2	ST.GALLER KANTONALBANK 2%/11-16.12.2019	590 000			590 000	637 200.00	0.01
2.625	ST.GALLER KANTONALBANK 2.625%/11-30.06.2021	2 180 000			2 180 000	2 465 580.00	0.04
2.75	ST.GALLER KANTONALBANK 2.75%/04-20.12.2016	1 605 000			1 605 000	1 669 200.00	0.03
3.25	ST.GALLER KANTONALBANK 3.25%/07-06.11.2015	850 000		850 000			
3.5	ST.GALLER KANTONALBANK 3.5%/07-27.07.2017	5 250 000			5 250 000	5 628 000.00	0.09
1.5	STADT BERN 1.5%/13-25.02.2028	2 000 000			2 000 000	2 230 000.00	0.03
1.625	STADT BERN 1.625%/11-01.11.2024	4 350 000			4 350 000	4 874 175.00	0.08
2.125	STADT BERN 2.125%/13-11.10.2038	1 390 000			1 390 000	1 760 435.00	0.03
2.5	STADT BERN 2.5%/05-26.09.2025	1 015 000			1 015 000	1 229 672.50	0.02
2.5	STADT BERN 2.5%/10-01.04.2025	300 000			300 000	363 000.00	0.01
2.5	STADT BERN 2.5%/11-01.04.2041	3 110 000			3 110 000	4 224 935.00	0.07
2.625	STADT BERN 2.625%/09-30.01.2019	2 100 000			2 100 000	2 299 500.00	0.04
3	STADT BERN 3%/08-31.03.2016	670 000			670 000	683 132.00	0.01
1.375	STADT BIEL 1.375%/14-24.09.2029		5 560 000		5 560 000	6 090 980.00	0.10
2.625	STADT BIEL 2.625%/06-03.03.2026	1 515 000			1 515 000	1 853 602.50	0.03
2.625	STADT BIEL 2.625%/09-12.04.2019	2 000 000			2 000 000	2 198 000.00	0.03
1.125	STADT GENEVA 1.125%/13-17.04.2023		1 870 000		1 870 000	2 011 185.00	0.03
1.375	STADT GENEVA 1.375%/12-19.11.2029	3 800 000			3 800 000	4 250 300.00	0.07
1.625	STADT GENF 1.625%/13-12.12.2024	1 000 000			1 000 000	1 126 000.00	0.02
0.625	STADT LAUSANNE 0.625%/15-04.03.2030	1 500 000	2 000 000		3 500 000	3 445 750.00	0.05
1	STADT LAUSANNE 1%/14-29.04.2022	1 000 000	250 000		1 250 000	1 324 375.00	0.02
1.25	STADT LAUSANNE 1.25%/12-07.06.2024	800 000	460 000		1 260 000	1 365 840.00	0.02

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.5	STADT LAUSANNE 1.5%/13-03.04.2028	1 380 000	200 000		1 580 000	1 752 220.00	0.03
0.875	STADT LUGANO 0.875%/13-09.12.2020	1 000 000	250 000		1 250 000	1 281 250.00	0.02
1.125	STADT LUGANO 1.125%/12-01.06.2022	3 000 000			3 000 000	3 135 000.00	0.05
1.75	STADT LUGANO 1.75%/13-20.02.2043	1 840 000	1 425 000		3 265 000	3 328 667.50	0.05
1.625	STADT STGALLEN 1.625%/11-10.11.2025	850 000			850 000	965 175.00	0.02
1.5	STADT WINTERTHUR 1.5%/13-24.01.2036	5 000 000			5 000 000	5 617 500.00	0.09
1.5	STADT WINTERTHUR 1.5%/14-06.06.2029	2 000 000	50 000		2 050 000	2 283 700.00	0.04
1.875	STADT WINTERTHUR 1.875%/12-20.04.2037	850 000			850 000	1 023 400.00	0.02
2.25	STADT WINTERTHUR 2.25%/14-10.02.2039	1 500 000			1 500 000	1 922 250.00	0.03
2.375	STADT WINTERTHUR 2.375%/06-15.02.2018	700 000			700 000	744 450.00	0.01
0.25	STADT ZUERICH 0.25%/14-21.08.2019	1 275 000			1 275 000	1 299 225.00	0.02
1	STADT ZUERICH 1%/12-05.12.2023	4 585 000	1 100 000		5 685 000	6 085 792.50	0.10
1	STADT ZUERICH 1%/14-25.04.2022	785 000	100 000		885 000	946 507.50	0.01
1	STADT ZUERICH 1%/14-30.03.2027	900 000			900 000	955 800.00	0.01
1.125	STADT ZUERICH 1.125%/14-06.03.2023	1 000 000	250 000		1 250 000	1 347 500.00	0.02
1.125	STADT ZUERICH 1.125%/15-26.06.2040		2 000 000	900 000	1 100 000	1 167 100.00	0.02
1.625	STADT ZUERICH 1.625%/13-26.09.2024	2 750 000			2 750 000	3 095 125.00	0.05
1.75	STADT ZUERICH 1.75%/14-06.03.2029	2 000 000			2 000 000	2 314 000.00	0.04
2	STADT ZUERICH 2%/13-18.12.2043	1 000 000			1 000 000	1 278 500.00	0.02
2.125	STADT ZUERICH 2.125%/05-12.08.2016	2 210 000	200 000		2 410 000	2 467 840.00	0.04
2.125	STADT ZUERICH 2.125%/10-10.06.2020	910 000	200 000		1 110 000	1 231 545.00	0.02
2.125	STADT ZUERICH 2.125%/13-26.09.2033	3 000 000			3 000 000	3 726 000.00	0.06
2.375	STADT ZUERICH 2.375%/09-10.09.2018	1 885 000			1 885 000	2 035 800.00	0.03
2.375	STADT ZUERICH 2.375%/11-21.02.2024	2 000 000	100 000		2 100 000	2 491 650.00	0.04
2.55	STADT ZUERICH 2.55%/06-10.03.2036	5 445 000	200 000		5 645 000	7 544 542.50	0.12
2.625	STADT ZUERICH 2.625%/11-10.06.2038	3 390 000			3 390 000	4 674 810.00	0.07
2.75	STADT ZUERICH 2.75%/05-14.02.2025	8 640 000	500 000		9 140 000	11 274 190.00	0.18
2.75	STADT ZUERICH 2.75%/09-20.02.2019	400 000			400 000	442 400.00	0.01
2.875	STADT ZUERICH 2.875%/09-21.04.2021	6 575 000	4 200 000		10 775 000	12 574 425.00	0.20
3	STADT ZUERICH 3%/07-08.06.2022	10 880 000			10 880 000	13 094 080.00	0.20
3.5	STADT ZUERICH 3.5%/08-14.08.2020	2 310 000	300 000		2 610 000	3 090 240.00	0.05
1.375	STATD LAUSANNE 1.375%/13-27.11.2023	1 000 000			1 000 000	1 101 500.00	0.02
1.625	STRAUMANN HOLDING 1.625%/13-30.04.2020	2 200 000			2 200 000	2 346 300.00	0.04
2.25	SULZER 2.25%/11-11.07.2016	3 200 000			3 200 000	3 250 240.00	0.05
0.5	SWISS CONFEDERATION 0.5%/15-27.05.2030		1 900 000		1 900 000	1 983 220.00	0.03
1.25	SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-11.06.2024	38 146 000	1 950 000		40 096 000	45 376 643.20	0.71
1.25	SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-27.06.2037	49 400 000	10 300 000		59 700 000	69 729 600.00	1.09
1.25	SWISS CONFEDERATION 1.25%/14-28.05.2026	17 200 000	3 650 000		20 850 000	23 775 255.00	0.37
1.5	SWISS CONFEDERATION 1.5%/12-30.04.2042	50 960 000	900 000		51 860 000	64 332 330.00	1.00
1.5	SWISS CONFEDERATION 1.5%/13-24.07.2025	22 920 000	7 500 000		30 420 000	35 332 830.00	0.55
2	SWISS CONFEDERATION 2%/05-12.10.2016	31 680 000	4 000 000		35 680 000	36 768 240.00	0.57
2	SWISS CONFEDERATION 2%/10-28.04.2021	50 160 000	4 350 000		54 510 000	62 337 636.00	0.97
2	SWISS CONFEDERATION 2%/11-25.05.2022	39 760 000	2 736 000		42 496 000	49 397 350.40	0.77
2	SWISS CONFEDERATION 2%/14-25.06.2064	20 050 000	5 760 000		25 810 000	38 908 575.00	0.61
2	SWISS CONFEDERATION 2%/14-25.06.2064		2 000 000	2 000 000			
2.25	SWISS CONFEDERATION 2.25%/05-06.07.2020	70 176 000	400 000		70 576 000	80 520 158.40	1.26
2.25	SWISS CONFEDERATION 2.25%/11-22.06.2031	25 590 000			25 590 000	33 561 285.00	0.52
2.5	SWISS CONFEDERATION 2.5%/03-12.03.2016	63 117 000		63 117 000			
2.5	SWISS CONFEDERATION 2.5%/06-08.03.2036	43 170 000	700 000		43 870 000	61 703 155.00	0.96
3	SWISS CONFEDERATION 3%/03-08.01.2018	80 594 000			80 594 000	87 766 866.00	1.37
3	SWISS CONFEDERATION 3%/04-12.05.2019	70 565 000	1 200 000	400 000	71 365 000	81 284 735.00	1.27
3.25	SWISS CONFEDERATION 3.25%/07-27.06.2027	28 470 000			28 470 000	39 260 130.00	0.61
3.5	SWISS CONFEDERATION 3.5%/03-08.04.2033	43 911 000	5 500 000		49 411 000	76 147 292.10	1.19
4	SWISS CONFEDERATION 4%/98-08.04.2028	70 545 000	1 400 000		71 945 000	107 118 910.50	1.67
4	SWISS CONFEDERATION 4%/98-11.02.2023	59 300 000	943 000		60 243 000	79 864 145.10	1.25
4	SWISS CONFEDERATION 4%/99-06.01.2049	16 730 000	3 400 000		20 130 000	40 400 910.00	0.63
4.25	SWISS CONFEDERATION 4.25%/97-05.06.2017	65 081 000	500 000		65 581 000	71 384 918.50	1.11
0.4	SWISS CREDIT CARD ISSUANCE -A- 0.4%/13-15.06.2016	2 525 000	300 000		2 825 000	2 833 475.00	0.04
1.125	SWISS LIFE HOLDING 1.125%/13-21.06.2019	6 500 000			6 500 000	6 724 250.00	0.10
1.875	SWISS LIFE HOLDING 1.875%/13-21.06.2023	3 000 000	1 995 000		4 995 000	5 449 545.00	0.09
1	SWISS PRIME SITE 1%/14-10.12.2019	1 100 000	50 000		1 150 000	1 187 375.00	0.02
1.125	SWISS PRIME SITE 1.125%/13-11.07.2018	1 250 000			1 250 000	1 287 500.00	0.02
1.75	SWISS PRIME SITE 1.75%/14-16.04.2021	3 500 000	1 150 000	130 000	4 520 000	4 746 000.00	0.07
2	SWISS PRIME SITE 2%/13-21.10.2020	2 000 000		110 000	1 890 000	2 003 400.00	0.03
1	SWISS PRIME SITE 2%/14-10.12.2024	1 300 000			1 300 000	1 372 800.00	0.02
0.75	SWISS REINSURANCE 0.75%/15-21.01.2027	6 500 000	5 490 000		11 990 000	12 127 885.00	0.19
1	SWISS REINSURANCE 1%/14-17.09.2024		50 000		50 000	52 500.00	0.00
2.125	SWISS REINSURANCE 2.125%/11-22.09.2017	8 950 000			8 950 000	9 352 750.00	0.15
1.5	SWISSCOM 1.5%/14-14.07.2026	4 700 000	1 400 000		6 100 000	6 713 050.00	0.10
1.5	SWISSCOM 1.5%/14-28.09.2029	5 000 000	2 000 000		7 000 000	7 738 500.00	0.12
1.75	SWISSCOM 1.75%/12-10.07.2024	6 850 000			6 850 000	7 658 300.00	0.12
2.625	SWISSCOM 2.625%/10-31.08.2022	5 950 000	2 050 000		8 000 000	9 332 000.00	0.15
3.25	SWISSCOM 3.25%/09-14.09.2018	19 070 000	150 000		19 220 000	21 218 880.00	0.33
3.75	SWISSCOM 3.75%/07-19.07.2017	6 450 000			6 450 000	6 914 400.00	0.11
4	SWISSCOM 4%/08-17.09.2015	4 250 000		4 250 000			
0.25	SWISSCOM T -1- 0.25%/15-17.04.2023		3 000 000		3 000 000	2 986 500.00	0.05
1	SWISSCOM T -2- 1%/15-17.04.2035		5 350 000		5 350 000	5 146 700.00	0.08
0.625	SWISSGRID 0.625%/15-25.02.2030	1 700 000			1 700 000	1 646 450.00	0.03
1	SWISSGRID 1%/13-30.01.2020	5 875 000	55 000		5 930 000	6 173 130.00	0.10
1.625	SWISSGRID 1.625%/13-30.01.2025	4 525 000			4 525 000	5 004 650.00	0.08
0.75	SYNGENTA FINANCE 0.75%/14-01.11.2019	2 700 000	50 000	150 000	2 600 000	2 668 900.00	0.04
1.625	SYNGENTA FINANCE 1.625%/14-01.11.2024	900 000	300 000	130 000	1 070 000	1 167 905.00	0.02
2.125	SYNGENTA FINANCE 2.125%/14-01.11.2029	750 000			750 000	861 750.00	0.01
3	TESSINER STAATSBANK 3%/07-15.06.2017	2 340 000	1 000 000		3 340 000	3 522 030.00	0.05
0.375	THURGAUER KANTONALBANK 0.375%/14-23.10.2020	500 000			500 000	510 500.00	0.01
0.375	THURGAUER KANTONALBANK 0.375%/15-31.03.2025		8 400 000		8 400 000	8 387 400.00	0.13
0.5	THURGAUER KANTONALBANK 0.5%/15-16.02.2029	2 000 000			2 000 000	1 952 000.00	0.03
1	THURGAUER KANTONALBANK 1%/12-30.11.2022	2 300 000			2 300 000	2 441 450.00	0.04
1.25	THURGAUER KANTONALBANK 1.25%/10-15.09.2017	350 000			350 000	360 850.00	0.01
1.5	THURGAUER KANTONALBANK 1.5%/13-04.03.2027	590 000			590 000	652 245.00	0.01
1.75	THURGAUER KANTONALBANK 1.75%/13-30.09.2024	4 750 000			4 750 000	5 353 250.00	0.08
2.25	THURGAUER KANTONALBANK 2.25%/11-25.02.2021	4 400 000			4 400 000	4 943 400.00	0.08

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
3	THURGAUER KANTONALBANK 3%/08-29.01.2016	3 380 000		3 380 000			
3.125	UBS 3.125%/06-28.06.2016	4 580 000			4 580 000	4 693 126.00	0.07
4.125	UBS 4.125%/07-27.12.2017	6 750 000		120 000	6 630 000	7 216 755.00	0.11
1	VALIANT BANK 1%/14-22.11.2019	2 000 000			2 000 000	2 065 000.00	0.03
1	VALIANT BANK AG 1%/12-20.11.2018	1 100 000			1 100 000	1 130 800.00	0.02
1.625	VILLE DE LAUSANNE 1.625%/11-30.09.2022	2 000 000			2 000 000	2 213 000.00	0.03
0.375	WALLISER KANTONALBANK 0.375%/14-15.12.2021	1 000 000	50 000		1 050 000	1 064 175.00	0.02
0.4	WALLISER KANTONALBANK 0.4%/15-15.09.2025		4 000 000		4 000 000	3 971 600.00	0.06
1.5	WALLISER KANTONALBANK 1.5%/13-28.10.2022		250 000		250 000	273 375.00	0.00
2.375	WALLISER KANTONALBANK 2.375%/11-18.05.2021	2 000 000			2 000 000	2 257 000.00	0.04
1.25	ZUERCHER KANTONALBANK 1.25%/12-31.01.2022	1 500 000	2 010 000		3 510 000	3 776 760.00	0.06
1.625	ZUERCHER KANTONALBANK 1.625%/12-12.04.2027	1 500 000			1 500 000	1 684 500.00	0.03
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK 2.125%/11-15.04.2019	3 000 000			3 000 000	3 250 500.00	0.05
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK S. 109 2.125%/10-05.02.2018	3 840 000			3 840 000	4 064 640.00	0.06
1.625	ZUERCHER KANTONALBANK S. 110 1.625%/10-03.03.2016	4 450 000			4 450 000	4 496 280.00	0.07
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK S. 111 2.125%/10-12.03.2020	3 230 000	200 000		3 430 000	3 779 860.00	0.06
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK S. 113 2.125%/10-29.06.2022	15 655 000	1 300 000		16 955 000	19 311 745.00	0.30
2	ZUERCHER KANTONALBANK S. 114 2%/10-08.09.2025	6 100 000	175 000		6 275 000	7 260 175.00	0.11
2	ZUERCHER KANTONALBANK S. 115 2%/10-30.11.2034	4 110 000	750 000		4 860 000	5 856 300.00	0.09
2	ZUERCHER KANTONALBANK S. 117 2%/11-21.01.2021	9 090 000	300 000		9 390 000	10 451 070.00	0.16
2.375	ZUERCHER KANTONALBANK S. 119 2.375%/11-29.03.2023	9 360 000			9 360 000	10 913 760.00	0.17
2.5	ZUERCHER KANTONALBANK S. 122 2.5%/11-10.06.2031	300 000			300 000	379 500.00	0.01
1.125	ZUERCHER KANTONALBANK S. 129 1.125%/13-29.01.2024		2 130 000		2 130 000	2 279 100.00	0.04
0.875	ZUERCHER KANTONALBANK S. 130 0.875%/13-17.05.2021	500 000	100 000		600 000	629 400.00	0.01
1.5	ZUERCHER KANTONALBANK S. 132 1.5%/14-27.01.2023		1 920 000		1 920 000	2 111 040.00	0.03
0.25	ZUERCHER KANTONALBANK S. 134 0.25%/15-31.03.2021		2 300 000		2 300 000	2 337 950.00	0.04
1	ZUERCHER KANTONALBANK S. 123 1%/11-14.12.2018	500 000			500 000	520 250.00	0.01
1.5	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 1.5%/12-25.06.2	6 420 000			6 420 000	6 760 260.00	0.11
2.25	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 2.25%/11-27.07.	5 970 000			5 970 000	6 220 740.00	0.10
2.375	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 2.375%/11-23.11	7 150 000	200 000		7 350 000	7 893 900.00	0.12
2.875	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 2.875%/11-27.07	8 850 000			8 850 000	10 261 575.00	0.16
0.5	ZUGER KANTONALBANK 0.5%/15-03.03.2027	2 500 000	1 000 000		3 500 000	3 480 750.00	0.05
0.625	ZUGER KANTONALBANK 0.625%/14-17.10.2022	2 500 000			2 500 000	2 588 750.00	0.04
1	ZUGER KANTONALBANK 1%/12-26.09.2022	2 000 000	1 000 000		3 000 000	3 184 500.00	0.05
1.125	ZUGER KANTONALBANK 1.125%/13-29.10.2020	500 000	200 000		700 000	741 650.00	0.01
1.5	ZUGER KANTONALBANK 1.5%/11-27.09.2021	5 940 000	1 500 000		7 440 000	8 120 760.00	0.13
1.5	ZUGER KANTONALBANK 1.5%/11-28.11.2023	2 550 000	1 450 000		4 000 000	4 412 000.00	0.07
1.65	ZUGER KANTONALBANK 1.65%/13-02.04.2038	4 000 000			4 000 000	4 610 000.00	0.07
1.75	ZUGER KANTONALBANK 1.75%/10-03.12.2019	1 390 000			1 390 000	1 501 200.00	0.02
1.875	ZUGER KANTONALBANK 1.875%/10-14.10.2020	4 250 000	150 000		4 400 000	4 831 200.00	0.08
2.125	ZUGER KANTONALBANK 2.125%/09-22.12.2017	4 300 000			4 300 000	4 534 350.00	0.07
2.375	ZUGER KANTONALBANK 2.375%/11-25.05.2021	4 400 000	200 000		4 600 000	5 216 400.00	0.08
3.125	ZURICH 3.125%/08-27.03.2017	2 140 000	2 000 000		4 140 000	4 365 630.00	0.07
0.625	ZURICH INSURANCE 0.625%/14-22.07.2020	2 500 000	100 000		2 600 000	2 665 000.00	0.04
1.5	ZURICH INSURANCE 1.5%/14-22.07.2026	2 000 000	5 950 000		7 950 000	8 665 500.00	0.14
1.125	ZURICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 1.125%/13-18.09.	3 500 000	100 000	110 000	3 490 000	3 633 090.00	0.06
1.875	ZURICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 1.875%/13-18.09.	1 550 000	200 000		1 750 000	1 945 125.00	0.03
						4 130 002 150.20	64.47
Slowakei							
1.375	SLOVAKIA 1.375%/13-16.10.2019	3 550 000	250 000		3 800 000	4 026 100.00	0.06
2.125	SLOVAKIA 2.125%/12-25.04.2018	4 190 000	200 000		4 390 000	4 679 740.00	0.07
2.125	SLOVAKIA 2.125%/13-16.10.2023	1 000 000			1 000 000	1 134 500.00	0.02
2.75	SLOVAKIA 2.75%/12-25.04.2022	650 000	420 000		1 070 000	1 245 480.00	0.02
						11 085 820.00	0.17
Spanien							
2	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2%/05-15.12.2016	8 000 000			8 000 000	8 220 000.00	0.13
2.25	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2.25%/09-07.11.2017	4 200 000			4 200 000	4 418 400.00	0.07
3.25	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 3.25%/07-28.06.2024	2 000 000			2 000 000	2 411 000.00	0.04
2.595	TELEFONICA EMISIONES 2.595%/13-23.10.2020	2 815 000		170 000	2 645 000	2 920 080.00	0.05
2.718	TELEFONICA EMISIONES 2.718%/12-14.12.2018	3 500 000			3 500 000	3 760 750.00	0.06
3.45	TELEFONICA EMISIONES 3.45%/12-14.12.2022	500 000	2 500 000		3 000 000	3 585 000.00	0.06
						25 315 230.00	0.40
Südafrika							
2	FIRSTRAND BANK 2%/14-28.05.2019	2 000 000			2 000 000	2 030 000.00	0.03
						2 030 000.00	0.03
Südkorea							
0.5	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 0.5%/14-20.10.2017	3 000 000			3 000 000	3 007 500.00	0.05
2.5	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 2.5%/12-15.02.2017	2 620 000	50 000	280 000	2 390 000	2 470 065.00	0.04
3	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 3%/11-27.05.2016	2 630 000			2 630 000	2 684 441.00	0.04
1.5	KEPCO 1.5%/13-23.04.2019	2 500 000	250 000		2 750 000	2 853 125.00	0.04
1	KOREA DEVELOPMENT BANK 1%/12-21.12.2018	90 000	100 000		190 000	194 845.00	0.00
1	KOREA DEVELOPMENT BANK 1%/12-29.10.2018	2 300 000			2 300 000	2 358 650.00	0.04
1.375	KOREA DEVELOPMENT BANK 1.375%/13-02.07.2018	1 225 000	50 000		1 275 000	1 318 350.00	0.02
1.5	KOREA DEVELOPMENT BANK 1.5%/12-23.05.2016	1 120 000			1 120 000	1 133 552.00	0.02
0.75	KOREA DISTRICT HEATING 0.75%/13-20.12.2016	400 000			400 000	402 960.00	0.01
1.125	KOREA GAS 1.125%/13-12.02.2020	2 900 000			2 900 000	3 013 100.00	0.05
2	KOREA GAS 2%/11-11.10.2016	1 300 000	100 000		1 400 000	1 428 700.00	0.02
2.875	KOREA GAS 2.875%/11-11.10.2019	4 940 000			4 940 000	5 480 930.00	0.09
2.25	KOREA GAS CORPORATION 2.25%/10-06.10.2015	700 000		700 000			
2.125	KOREA LAND & HOUSING CORPORATION 2.125%/11-12.12.2	100 000			100 000	102 590.00	0.00
1.625	KOREA NATIONAL OIL 1.625%/13-29.11.2018	1 000 000			1 000 000	1 040 000.00	0.02
1.875	KOREA NATIONAL OIL 1.875%/12-08.03.2017	4 100 000			4 100 000	4 206 600.00	0.07
2.625	KOREA NATIONAL OIL 2.625%/11-12.05.2016	2 500 000			2 500 000	2 545 750.00	0.04
1	KOREA RAILROAD 1%/12-16.11.2018	300 000			300 000	307 500.00	0.00
1.5	KOREA RAILROAD 1.5%/13-02.12.2019	5 500 000			5 500 000	5 731 000.00	0.09
1.625	KOREA WESTERN POWER 1.625%/13-26.03.2019	3 000 000			3 000 000	3 118 500.00	0.05
2	LG ELECTRONICS 2%/12-02.12.2016	1 230 000			1 230 000	1 253 616.00	0.02
1.75	SK TELECOM 1.75%/12-12.06.2017	2 230 000	100 000		2 330 000	2 387 085.00	0.04
						47 038 859.00	0.73
Tschechische Republik							
2.875	CZECH REPUBLIC 2.875%/09-23.11.2016	6 940 000			6 940 000	7 212 742.00	0.11
						7 212 742.00	0.11

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
USA							
2.75	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 2.75%/06-21.12.2016	1 960 000		1 960 000			
3.375	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 3.375%/07-29.06.2017	1 500 000		1 500 000			
0.375	APPLE 0.375%/15-25.11.2024	11 000 000	200 000		11 200 000	11 261 600.00	0.18
0.75	APPLE 0.75%/15-25.02.2030	8 000 000	5 200 000		13 200 000	13 259 400.00	0.21
0.5	AT&T 1.875%/14-04.12.2019	5 000 000			5 000 000	5 065 000.00	0.08
1.375	AT&T 1.875%/14-04.12.2024	5 000 000	1 570 000		6 570 000	6 859 080.00	0.11
1.875	AT&T 1.875%/14-04.12.2030	5 900 000	1 700 000		7 600 000	8 333 400.00	0.13
2.5	BANK OF AMERICA 2.5%/05-28.09.2017	3 700 000			3 700 000	3 886 850.00	0.06
3	BANK OF AMERICA 3%/10-23.12.2016	6 100 000	100 000		6 200 000	6 451 100.00	0.10
3.25	BANK OF AMERICA 3.25%/06-14.06.2016	310 000			310 000	318 215.00	0.00
2.375	CITIGROUP 2.375%/05-23.09.2015	1 160 000		1 160 000			
3	CITIGROUP 3%/07-21.03.2019	500 000		500 000			
3.125	CITIGROUP 3.125%/06-27.09.2021	11 100 000	250 000		11 350 000	13 222 750.00	0.21
4.875	CREDIT SUISSE NEW YORK BRANCH (subordinated) 4.875	7 360 000	150 000		7 510 000	8 343 610.00	0.13
1.625	GECC 1.625%/12-19.10.2017	3 950 000			3 950 000	4 113 925.00	0.06
2.25	GECC 2.25%/11-19.12.2016	1 840 000			1 840 000	1 898 328.00	0.03
2.5	GECC 2.5%/06-08.02.2018	3 000 000	100 000		3 100 000	3 304 600.00	0.05
2.625	GECC 2.625%/10-20.01.2016	4 500 000		4 500 000			
2.875	GECC 2.875%/07-27.02.2017	3 465 000			3 465 000	3 633 052.50	0.06
3.125	GECC 3.125%/04-06.12.2019	14 500 000	200 000		14 700 000	16 611 000.00	0.26
3.375	GECC 3.375%/06-19.06.2018	4 630 000		150 000	4 480 000	4 912 320.00	0.08
4.5	GECC 4.5%/08-09.10.2018	5 060 000			5 060 000	5 773 460.00	0.09
1.25	GOLDMAN SACHS GROUP 1.25%/14-11.09.2019	1 500 000	100 000		1 600 000	1 666 400.00	0.03
1.5	GOLDMAN SACHS GROUP 1.5%/12-29.11.2018	3 500 000	200 000	100 000	3 600 000	3 749 400.00	0.06
1.625	GOLDMAN SACHS GROUP S. -F. 1.625%/13-06.02.2020	3 300 000	200 000		3 500 000	3 713 500.00	0.06
3.25	HSBC FINANCE 3.25%/06-14.07.2016	9 335 000	100 000		9 435 000	9 718 050.00	0.15
5.5	IBRD 5.5%/86-05.02.2016	5 330 000		5 330 000			
2.75	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMEN	1 400 000			1 400 000	1 575 000.00	0.02
0.5	JP MORGAN CHASE 0.5%/15-04.12.2023	4 500 000			4 500 000	4 455 000.00	0.07
1.125	JPMORGAN CHASE 1.125%/14-06.11.2020	1 600 000	100 000		1 700 000	1 779 050.00	0.03
1.875	MCDONALD'S 1.875%/10-23.06.2016	1 240 000		1 000 000	240 000	243 984.00	0.00
0.75	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.75%/14-1704.201	3 500 000			3 500 000	3 594 500.00	0.06
1	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 1%/14-19.09.2022	4 000 000			4 000 000	4 168 000.00	0.07
1.125	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 1.125%/13-18.06	2 550 000	1 300 000		3 850 000	4 034 800.00	0.06
3.125	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 3.125%/06-27.06	1 890 000			1 890 000	1 945 188.00	0.03
0.625	MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625%/15-30.12.2021		7 000 000		7 000 000	7 031 500.00	0.11
1.125	MONDELEZ INTERNATIONAL 1.125%/15-30.12.2025		3 480 000		3 480 000	3 509 580.00	0.05
2.5	MORGAN STANLEY 2.5%/05-17.11.2015	3 900 000	250 000	4 150 000			
3.125	MORGAN STANLEY 3.125%/06-21.11.2018	5 950 000	400 000		6 350 000	6 972 300.00	0.11
2.625	NESTLE HOLDINGS 2.625%/07-14.02.2018	5 170 000			5 170 000	5 552 580.00	0.09
0.375	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.375%/15-02.02.2022	11 000 000			11 000 000	11 143 000.00	0.17
0.5	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.5%/14-13.05.2019	2 000 000			2 000 000	2 027 000.00	0.03
0.75	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 0.75%/0.75%/14-16.12	3 500 000			3 500 000	3 587 500.00	0.06
0.875	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 0.875%/13-11.03.2019	3 000 000			3 000 000	3 081 000.00	0.05
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1%/11-06.12.2016	2 090 000			2 090 000	2 116 125.00	0.03
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1%/12-18.09.2020	4 140 000	150 000		4 290 000	4 450 875.00	0.07
1.625	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1.625%/14-16.05.2024	3 500 000	50 000	110 000	3 440 000	3 763 360.00	0.06
2	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 2%/11-06.12.2021	3 690 000			3 690 000	4 057 155.00	0.06
2.875	TOYOTA MOTOR CREDIT 2.875%/06-20.09.2016	17 110 000		160 000	16 950 000	17 512 740.00	0.27
0.625	WELLS FARGO & CO 0.625%/14-03.09.2020	2 500 000			2 500 000	2 555 000.00	0.04
1.25	WELLS FARGO & CO 1.25%/14-03.09.2024	2 700 000	100 000		2 800 000	2 975 000.00	0.05
0.375	WELLS FARGO & COMPANY 0.375%/15-02.06.2022		3 000 000		3 000 000	3 021 000.00	0.05
						241 246 277.50	3.77
Venezuela							
0.45	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/15-07.09.2023		2 500 000		2 500 000	2 497 250.00	0.04
0.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.5%/15-26.02.2026	3 000 000	250 000		3 250 000	3 149 250.00	0.05
2.75	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.75%/11-03.02.2017	2 435 000			2 435 000	2 536 052.50	0.04
1.375	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.375%/13-11.02.2021	3 000 000	100 000		3 100 000	3 317 000.00	0.05
2.625	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.625%/10-05.11.2015	1 900 000		1 900 000			
						11 499 552.50	0.18
Vereinigte Arabische Emirate							
3	FIRST GULF BANK 3%/11-16.02.2016	2 280 000		2 280 000			
2.75	ICICI BANK DUBAI 2.75%/13-07.01.2020	1 000 000			1 000 000	1 046 500.00	0.02
						1 046 500.00	0.02
Vereinigtes Königreich							
2.125	ANZ NATIONAL INTERNATIONAL LIMITED 2.125%/11-25.02	2 260 000		2 260 000			
0.875	ANZ NEW ZEALAND 0.875%/13-14.02.2019	2 600 000			2 600 000	2 675 400.00	0.04
1	ANZ NEW ZEALAND 1%/14-10.03.2020	2 440 000		140 000	2 300 000	2 393 150.00	0.04
1.5	ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 1.5%/12-27.02.2018	2 630 000	2 800 000		5 430 000	5 682 495.00	0.09
1.125	ASB FINANCE 1.125%/14-05.02.2020	3 250 000			3 250 000	3 402 750.00	0.05
0.875	ASB FINANCE LONDON 0.875%/13-11.06.2019	3 000 000	250 000		3 250 000	3 362 125.00	0.05
2.125	ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH 2.125%/10-17.11.2016	1 550 000			1 550 000	1 590 145.00	0.02
1.375	ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH S. 2 1.375%/12-02.11	1 050 000	2 000 000	500 000	2 550 000	2 673 675.00	0.04
2.86	BANK OF SCOTLAND 2.86%/06-13.12.2021	3 520 000		110 000	3 410 000	3 546 400.00	0.06
3	BANK OF SCOTLAND 3%/06-26.05.2016	4 350 000			4 350 000	4 451 790.00	0.07
2.5	BARCLAYS BANK 2.5%/11-29.03.2016	7 100 000	3 810 000	6 910 000	4 000 000	4 062 800.00	0.06
1.375	BAT HOLDINGS 1.375%/14-08.09.2026	1 000 000	560 000	130 000	1 430 000	1 515 800.00	0.02
0.625	BATELCO INTERNATIONAL FINANCE 0.625%/14-08.09.2021	1 000 000			3 000 000	3 076 500.00	0.05
0.25	BNZ INTERNATIONAL FUNDING 0.25%/15-24.06.2022		2 500 000		2 500 000	2 482 500.00	0.04
1.125	BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.125%/12-20.09.2019	2 400 000	1 100 000	110 000	3 390 000	3 535 770.00	0.06
1.375	BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.375%/14-03.02.2021	3 300 000		80 000	3 220 000	3 429 300.00	0.05
0.75	BP CAPITAL MARKETS 0.75%/14-27.09.2021	4 000 000	2 000 000		6 000 000	6 177 000.00	0.10
1	BP CAPITAL MARKETS 1%/14-28.08.2020	2 700 000			2 700 000	2 822 850.00	0.04
1.75	BP CAPITAL MARKETS 1.75%/14-28.02.2024	950 000	200 000		1 150 000	1 274 775.00	0.02
3	BP CAPITAL MARKETS 3%/07-14.06.2017	3 650 000			3 650 000	3 841 625.00	0.06
3	BRADFORD & BINGLEY 3%/06-01.06.2016	1 850 000			1 850 000	1 896 990.00	0.03
0.375	CREDIT AGRICOLE 0.375%/15-27.01.2020	1 500 000			1 500 000	1 509 750.00	0.02
0.625	CREDIT AGRICOLE 0.625%/15-15.09.2023		5 000 000		5 000 000	4 997 500.00	0.08
1	CREDIT AGRICOLE 1%/14-08.10.2021	2 500 000			2 500 000	2 578 750.00	0.04
1	CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025	1 500 000	2 490 000		3 990 000	4 049 850.00	0.06
1.25	CREDIT AGRICOLE 1.25%/14-17.07.2020	2 500 000	50 000		2 550 000	2 671 125.00	0.04

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.125 CREDIT AGRICOLE LONDON 2.125%/14-30.10.2024	3 000 000	740 000		3 740 000	4 185 060.00	0.07
1 CREDIT SUISSE LONDON 1%/14-24.09.2021	4 000 000	3 000 000		7 000 000	7 241 500.00	0.11
1.875 HSBC BANK 1.875%/10-01.09.2016	900 000			900 000	920 340.00	0.01
2.375 HSBC BANK 2.375%/11-04.04.2018	4 750 000			4 750 000	5 054 000.00	0.08
2.75 HSBC BANK 2.75%/07-03.04.2017	7 460 000			7 460 000	7 814 350.00	0.12
2.75 NETWORK RAIL INFRASTRUCTURE FINANCE 2.75%/06-06.10	9 255 000	300 000		9 555 000	11 251 012.50	0.18
3.375 STATE BANK OF INDIA 3.375%/11-22.02.2016	1 500 000			1 500 000	1 522 350.00	0.02
2.75 THE ROYAL BANK OF SCOTLAND 2.75%/10-08.10.2015	2 930 000		2 930 000			
0.625 WESTPAC SECURITIES NZ - LONDON BRANCH 0.625%/14-02	250 000			250 000	256 500.00	0.00
					117 945 927.50	1.84
Total Obligationen					6 342 998 356.20	99.02
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					6 342 998 356.20	99.02
Total Anlagen					6 342 998 356.20	99.02
Bankguthaben auf Sicht					2 640 138.93	0.04
Sonstige Vermögenswerte					59 994 684.00	0.94
Gesamtfondsvermögen (GFV)					6 405 633 179.13	100.00
./. Bankverbindlichkeiten					0.91	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten					50 742.86	0.00
Nettofondsvermögen					6 405 582 435.36	100.00

¹ Umfassen Käufe und Verkäufe sowie Corporate Actions

Gemäss § 18 des Fondsreglements wurden in der Berichtsperiode folgende Anteile gegen Effekten statt in bar ausgegeben bzw. zurückgenommen:

Klasse	Datum	Anteile	Währung	NAV	Ausgabe	Rücknahme
Z	10.03.2015	15 539.275	CHF	1 158.09	x	
Z	18.03.2015	15 539.375	CHF	1 158.09	x	
Z	24.03.2015	8 500.062	CHF	1 158.31	x	
Z	23.04.2015	51 009.365	CHF	1 143.88	x	
Z	23.04.2015	6 061.169	CHF	1 143.88	x	
Z	20.05.2015	3 445	CHF	1 130.86	x	
Z	20.05.2015	8 805	CHF	1 126.28		x
D	20.05.2015	22 872.414	CHF	1 122.45	x	
Z	12.06.2015	8 922.572	CHF	1 122.51	x	
Z	19.06.2015	11 150	CHF	1 123.02		x
Z	06.08.2015	2 472.027	CHF	1 132.90	x	
D	07.08.2015	2 404.010	CHF	1 139.16	x	
D	18.08.2015	4 947.298	CHF	1 139.97	x	

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. März 2015 bis zum 31. August 2015

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen- Währung	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	In % des GFV
08.04.2015	Kauf	CHF	60 786.73	EUR	58 359.00		
Total Devisentermingeschäfte						0.00	0.00

Kurze Übersicht

Kennzahlen		31.08.2015	28.02.2015	28.02.2014
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	374.1	393.7	247.2
Anteilklasse D				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	152.5	199.5	159.2
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 018.53	1 038.96	1 013.90
Anteilklasse F				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	34.0	32.8	47.0
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 014.98	1 035.00	1 010.06
Anteilklasse Z				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	187.5	161.4	41.0
Inventarwert pro Anteil	CHF	1 014.67	1 035.40	1 010.42

**Vermögens-
rechnung per
31. August 2015**

	31.08.2015 CHF	Konsolidierung 28.02.2015 CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
– Sichtguthaben	200 112.68	917 798.84
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	370 513 736.00	389 472 188.00
Sonstige Vermögenswerte	3 390 400.91	3 314 522.35
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	374 104 249.59	393 704 509.19
Andere Verbindlichkeiten	16 124.53	16 801.25
Nettofondsvermögen	374 088 125.06	393 687 707.94
Anzahl Anteile im Umlauf	368 101.002	379 580.145

	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	Konsolidierung 01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	393 687 707.94	247 207 210.84
Ordentliche Jahresausschüttung / Ablieferung VST	–7 869 774.94	–5 340 788.32
Ausgaben von Anteilen	48 189 329.27	224 503 622.83
Rücknahmen von Anteilen	–59 970 297.54	–86 802 261.06
Sonstiges aus Anteilverkehr	646 939.20	–2 355 312.13
Gesamterfolg	–595 778.87	16 475 235.78
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	374 088 125.06	393 687 707.94
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	379 580.145	244 134.461
Ausgegebene Anteile	46 775.575	220 973.170
Zurückgenommene Anteile	–58 254.718	–85 527.486
Bestand am Ende der Berichtsperiode	368 101.002	379 580.145

Inventarwert pro Anteil
Ausserbilanzgeschäfte

Keine

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
199 455 034.17	159 173 297.58	32 838 986.49	47 014 469.25	161 393 687.28	41 019 444.01
–3 291 821.78	–3 622 584.22	–642 998.58	–698 958.09	–3 934 954.58	–1 019 246.01
4 958 300.62	79 539 269.48	4 515 368.42	18 149 091.87	38 715 660.23	126 815 261.48
–48 619 136.04	–44 092 790.55	–2 691 561.80	–33 058 727.05	–8 659 599.70	–9 650 743.46
323 180.11	190 830.28	35 700.09	66 578.20	288 059.00	–2 612 720.61
–291 866.21	8 267 011.60	–47 158.03	1 366 532.31	–256 754.63	6 841 691.87
152 533 690.87	199 455 034.17	34 008 336.59	32 838 986.49	187 546 097.60	161 393 687.28
191 976.094	156 991.749	31 728.514	46 546.421	155 875.537	40 596.291
4 845.027	78 249.557	4 427.983	17 930.925	37 502.565	124 792.688
–47 061.815	–43 265.212	–2 650.156	–32 748.832	–8 542.747	–9 513.442
149 759.306	191 976.094	33 506.341	31 728.514	184 835.355	155 875.537
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
1 018.53	1 038.96	1 014.98	1 035.00	1 014.67	1 035.40

**Erfolgsrechnung
für die Zeit vom
1. März 2015 bis
zum 31. August
2015**

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	0.00	474.82
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige		
Forderungswertpapiere und -rechte	3 676 747.29	5 998 575.49
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	165 569.21	2 886 408.21
Total Erträge abzüglich	3 842 316.50	8 885 458.52
Passivzinsen	394.76	0.00
Negativzinsen	1 384.04	0.00
Reglementarische Vergütung an:		
– die Fondsleitung	98 466.89	202 731.06
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	274 821.20	836 106.50
Nettoertrag	3 467 249.61	7 846 620.96
Realisierte Kapitalgewinne	326 111.12	1 104 474.51
Realisierte Kapitalverluste	–1 933 607.34	–2 555 545.89
Realisierter Erfolg	1 859 753.39	6 395 549.58
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	–2 455 532.26	10 079 686.20
Gesamterfolg	–595 778.87	16 475 235.78

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
0.00	309.94	0.00	56.09	0.00	108.79
1 627 760.17	3 816 654.30	319 599.76	680 154.79	1 729 387.36	1 501 766.40
19 514.20	821 115.36	24 095.36	175 011.49	121 959.65	1 890 281.36
1 647 274.37	4 638 079.60	343 695.12	855 222.37	1 851 347.01	3 392 156.55
167.52	0.00	34.01	0.00	193.23	0.00
568.89	0.00	126.44	0.00	688.71	0.00
72 842.46	154 122.05	25 624.43	48 609.01	0.00	0.00
195 962.22	570 637.37	20 379.06	186 319.24	58 479.92	79 149.89
1 377 733.28	3 913 320.18	297 531.18	620 294.12	1 791 985.15	3 313 006.66
171 602.77	709 064.06	28 296.29	142 785.16	126 212.06	252 625.29
–826 204.92	–1 444 271.62	–174 392.78	–263 905.49	–933 009.64	–847 368.78
723 131.13	3 178 112.62	151 434.69	499 173.79	985 187.57	2 718 263.17
–1 014 997.34	5 088 898.98	–198 592.72	867 358.52	–1 241 942.20	4 123 428.70
–291 866.21	8 267 011.60	–47 158.03	1 366 532.31	–256 754.63	6 841 691.87

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Obligationen							
Banken und andere Kreditinstitute							
1	ABN AMRO BANK 1%/12-19.04.2017	635 000			635 000	648 335.00	0.17
1.125	ABN AMRO BANK 1.125%/13-25.10.2018	700 000			700 000	722 050.00	0.19
1.125	ABN AMRO BANK 1.125%/14-24.04.2020	550 000			550 000	575 025.00	0.15
1.125	ABN AMRO BANK 1.125%/14-31.01.2019	1 050 000			1 050 000	1 085 700.00	0.29
1.5	ABN AMRO BANK 1.5%/13-27.12.2019	200 000			200 000	211 900.00	0.06
2.25	ABN AMRO BANK 2.25%/11-10.07.2018	820 000			820 000	879 040.00	0.23
2.375	ABN AMRO BANK 2.375%/11-02.02.2016	540 000		540 000			
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/06-30.12.2015	500 000		500 000			
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/12-16.02.2017	380 000			380 000	393 300.00	0.11
2.625	ABN AMRO BANK 2.625%/11-27.04.2021	380 000			380 000	434 340.00	0.12
3.125	ABN AMRO BANK 3.125%/11-27.04.2021	100 000			100 000	116 250.00	0.03
3.125	ABN AMRO BANK 3.125%/11-28.06.2021	10 000			10 000	11 495.00	0.00
3.375	ABN AMRO BANK 3.375%/06-15.08.2031	300 000			300 000	425 700.00	0.11
3	ABU DHABI COMMERCIAL BANK 3%/11-08.12.2015	150 000		150 000			
3.5	ACHMEA BANK 3.5%/07-22.08.2017	100 000			100 000	106 950.00	0.03
1.875	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 1.875%/10-12.11.		870 000		870 000	1 035 735.00	0.28
2.625	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 2.625%/10-18.02.	420 000	350 000		770 000	943 250.00	0.25
1.5	ANZ BANKING GROUP 1.5%/12-13.02.2019	270 000			270 000	286 200.00	0.08
2.125	ANZ NATIONAL INTERNATIONAL LIMITED 2.125%/11-25.02	100 000		100 000			
0.875	ANZ NEW ZEALAND 0.875%/13-14.02.2019	510 000			510 000	524 790.00	0.14
1	ANZ NEW ZEALAND 1%/14-10.03.2020	600 000			600 000	624 300.00	0.17
1.5	ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 1.5%/12-27.02.2018	1 100 000			1 100 000	1 151 150.00	0.31
2	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2%/10-08.07.	480 000			480 000	490 560.00	0.13
2.625	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2.625%/11-27	190 000			190 000	201 685.00	0.05
1.375	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1.375%/14-09.05.20	450 000			450 000	450 900.00	0.12
1.25	BANCO DE CHILE 1.25%/14-21.03.2019	700 000			700 000	718 550.00	0.19
1.5	BANCO DE CHILE 1.5%/13-03.12.2019	350 000			350 000	367 325.00	0.10
0.875	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 0.875%/14-23.11.2	1 140 000			1 140 000	1 162 230.00	0.31
1.125	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 1.125%/14-26.06.2	650 000			650 000	666 900.00	0.18
1.25	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 1.25%/13-26.09.20	300 000			300 000	303 420.00	0.08
2.5	BANCO DO BRASIL CAYMAN 2.5%/13-20.06.2019	540 000			540 000	538 650.00	0.14
1.625	BANCO GENERAL 1.625%/14-18.06.2018	1 430 000			1 430 000	1 444 300.00	0.39
2.75	BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONOMICO E SOCI	330 000			330 000	333 465.00	0.09
1.5	BANCO SAFRA 1.5%/14-11.12.2019	200 000			200 000	199 000.00	0.05
1.85	BANCO SAFRA 1.85%/14-27.06.2017	500 000			500 000	505 250.00	0.14
0.375	BANCO SANTANDER 0.375%/15-19.05.2022		600 000		600 000	594 000.00	0.16
3.25	BANCO SANTANDER BRAZIL S.A. GRAND CAYMAN BRANCH 3.	1 000 000		1 000 000			
1	BANCO SANTANDER CHILE 1%/14-31.07.2017	110 000			110 000	111 650.00	0.03
1.75	BANCO SANTANDER CHILE 1.75%/13-26.09.2019	300 000			300 000	316 050.00	0.08
2.25	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN 2.25%/11-23.02.2021	250 000	1 000 000		1 250 000	1 427 500.00	0.38
2.5	BANK OF AMERICA 2.5%/05-28.09.2017	420 000			420 000	441 210.00	0.12
3	BANK OF AMERICA 3%/10-23.12.2016	950 000			950 000	988 475.00	0.26
3.25	BANK OF AMERICA 3.25%/06-14.06.2016	120 000		120 000			
2.86	BANK OF SCOTLAND 2.86%/06-13.12.2021	250 000			250 000	260 000.00	0.07
3	BANK OF SCOTLAND 3%/06-26.05.2016	330 000		330 000			
2.5	BARCLAYS BANK 2.5%/11-29.03.2016	560 000		560 000			
1.25	BAWAG P.S.K. 1.25%/10-30.09.2015	170 000		170 000			
3	BAYERISCHE LB 3%/04-27.11.2015	170 000		170 000			
3.125	BAYERISCHE LB 3.125%/07-27.06.2018	630 000			630 000	692 685.00	0.19
1.125	BENDIGO & ADEL 1.125%/14-25.03.2019	200 000			200 000	207 000.00	0.06
1.125	BFCM 1.125%/14-12.02.2019	890 000			890 000	922 040.00	0.25
1.125	BFCM 1.125%/14-22.05.2020	570 000			570 000	592 230.00	0.16
1.625	BFCM 1.625%/13-11.04.2023	140 000			140 000	148 890.00	0.04
2	BFCM 2%/14-22.05.2024	100 000			100 000	110 000.00	0.03
0.875	BK OF COMMUNICATIONS - HONG KONG BRANCH 0.875%/14-	450 000			450 000	453 375.00	0.12
1.25	BNG 1.25%/14-30.04.2024	740 000			740 000	815 480.00	0.22
1.5	BNG 1.5%/10-03.11.2017	1 100 000		1 100 000			
1.75	BNG 1.75%/10-27.10.2020	110 000			110 000	122 155.00	0.03
2.125	BNG 2.125%/10-06.11.2018	800 000			800 000	868 000.00	0.23
2.25	BNG 2.25%/05-14.10.2020	2 040 000			2 040 000	2 322 540.00	0.62
2.375	BNG 2.375%/10-19.11.2019	965 000			965 000	1 081 765.00	0.29
2.5	BNG 2.5%/05-21.07.2025	2 570 000			2 570 000	3 158 530.00	0.84
2.5	BNG 2.5%/09-14.10.2019	760 000			760 000	854 240.00	0.23
2.625	BNG 2.625%/07-09.02.2017	770 000			770 000	805 805.00	0.22
2.75	BNG 2.75%/09-11.05.2016	970 000		970 000			
3.125	BNG 3.125%/07-02.07.2018	890 000			890 000	987 010.00	0.26
3.25	BNG 3.25%/07-29.06.2037	260 000			260 000	398 580.00	0.11
1.875	BNP PARIBAS 1.875%/12-12.09.2022	550 000			550 000	609 125.00	0.16
2.375	BNP PARIBAS HOME LOAN COVERED BONDS 2.375%/11-07.1	570 000			570 000	641 820.00	0.17
1.5	BPCE 1.5%/14-30.04.2021	300 000			300 000	321 300.00	0.09
2.75	BRADFORD & BINGLEY 2.75%/06-16.10.2018	330 000			330 000	359 700.00	0.10
3	BRADFORD & BINGLEY 3%/06-01.06.2016	200 000			200 000	205 080.00	0.05
1.125	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.125%/12-21.	520 000			520 000	536 120.00	0.14
1.625	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.625%/12-05.	220 000			220 000	235 400.00	0.06
1.75	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.75%/13-26.0	440 000			440 000	504 240.00	0.13
1.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.25%/13-16.12.	1 200 000	200 000		1 400 000	1 507 100.00	0.40
3.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.25%/07-13.11.	300 000			300 000	324 750.00	0.09
3.625	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.625%/08-16.04	300 000			300 000	331 950.00	0.09
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-09.08.2017	630 000			630 000	677 880.00	0.18
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-28.08.2019	290 000			290 000	332 630.00	0.09
2.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.5%/09-02.0	800 000			800 000	862 400.00	0.23
2.625	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.625%/09-12	760 000			760 000	845 500.00	0.23
1	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 1%/12-13.02.201	770 000			770 000	805 805.00	0.22
1.75	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE LONDON 1.75%/10	690 000			690 000	717 600.00	0.19
2	CFF 2%/10-20.12.2017	800 000			800 000	843 600.00	0.23
2.125	CFF 2.125%/11-11.05.2016	300 000		300 000			

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.25	CFF 2.25%/10-13.10.2021	1 570 000			1 570 000	1 793 725.00	0.48
2.25	CFF 2.25%/11-09.08.2019	510 000			510 000	559 980.00	0.15
2.375	CFF 2.375%/05-24.08.2018	2 480 000			2 480 000	2 679 640.00	0.72
2.5	CFF 2.5%/06-24.02.2031	1 210 000	250 000		1 460 000	1 862 960.00	0.50
2.75	CFF 2.75%/04-15.11.2016	240 000			240 000	249 264.00	0.07
2.875	CFF 2.875%/09-10.09.2019		200 000		200 000	225 300.00	0.06
3	CFF 3%/07-07.06.2022	560 000			560 000	670 880.00	0.18
3	CFF 3%/08-19.08.2016	440 000			440 000	454 960.00	0.12
3	CITIGROUP 3%/07-21.03.2019	300 000		300 000			
3.125	CITIGROUP 3.125%/06-27.09.2021	840 000			840 000	978 600.00	0.26
1.5	COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA 1.5%/12-13.09.2019	1 190 000			1 190 000	1 270 325.00	0.34
0.875	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875%/13-11.02.202	270 000			270 000	280 530.00	0.07
1	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1%/13-25.09.2018	800 000			800 000	824 800.00	0.22
1.5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.5%/14-07.02.2022	600 000			600 000	649 800.00	0.17
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3%/09-09.11.2017	1 370 000			1 370 000	1 459 735.00	0.39
1.5	COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.5%/14-19.02.202	500 000			500 000	551 250.00	0.15
0.375	CREDIT AGRICOLE 0.375%/15-27.01.2020	300 000			300 000	301 950.00	0.08
0.625	CREDIT AGRICOLE 0.625%/15-15.09.2023		400 000		400 000	399 800.00	0.11
1	CREDIT AGRICOLE 1%/14-08.10.2021	400 000			400 000	412 600.00	0.11
1	CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025	700 000			700 000	710 500.00	0.19
1.25	CREDIT AGRICOLE 1.25%/14-17.07.2020	1 170 000	1 000 000	470 000	1 700 000	1 780 750.00	0.48
0.5	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.5%/15-16.03.2027		650 000		650 000	656 500.00	0.18
1.125	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.125%/14-05.06.2024	200 000			200 000	215 900.00	0.06
1.125	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.125%/14-12.08.2021	700 000			700 000	747 950.00	0.20
1.375	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.375%/12-30.07.2018	810 000			810 000	849 285.00	0.23
1.75	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 1.75%/10-27.07.2017	460 000			460 000	479 780.00	0.13
2.125	CREDIT AGRICOLE LONDON 2.125%/14-30.10.2024	300 000			300 000	335 700.00	0.09
3.125	CREDIT SUISSE GUERNSEY BRANCH 3.125%/10-12.11.2030	200 000			200 000	248 000.00	0.07
1	CREDIT SUISSE LONDON 1%/14-24.09.2021	920 000	1 000 000		1 920 000	1 986 240.00	0.53
4.875	CREDIT SUISSE NEW YORK BRANCH (subordinated) 4.875	1 710 000			1 710 000	1 899 810.00	0.51
1.375	CRH 1.375%/13-15.03.2023	535 000			535 000	584 220.00	0.16
1.875	CRH 1.875%/12-23.05.2022	550 000			550 000	616 000.00	0.16
2.375	CRH 2.375%/12-05.03.2024	790 000			790 000	932 595.00	0.25
2.5	CRH 2.5%/11-29.03.2021	450 000	900 000		1 350 000	1 542 375.00	0.41
1.5	DANSKE BANK 1.5%/12-21.12.2016	170 000			170 000	173 213.00	0.05
2.125	DANSKE BANK 2.125%/11-17.05.2018		150 000		150 000	160 650.00	0.04
2.375	DANSKE BANK 2.375%/09-13.01.2017	900 000			900 000	933 660.00	0.25
3.125	DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRALE 3.125%/04-16.12.201	290 000		290 000			
0.625	DEUTSCHE BANK 0.625%/15-19.12.2023		800 000		800 000	784 400.00	0.21
1.75	DNB BANK ASA 1.75%/12-18.04.2018	150 000			150 000	156 900.00	0.04
1.5	DNB BOLIGKREDIT 1.5%/11-24.02.2017	830 000			830 000	854 070.00	0.23
2.25	DNB BOLIGKREDIT 2.25%/10-26.03.2018	400 000			400 000	427 400.00	0.11
3.375	DNB BOLIGKREDIT 3.375%/07-16.11.2016	380 000			380 000	397 860.00	0.11
3.375	DNB BOLIGKREDIT 3.375%/08-13.07.2016	690 000			690 000	713 322.00	0.19
3.238	DZ BANK (subordinated) 3.238%/13-30.08.2023	120 000			120 000	132 000.00	0.04
2	DZ BANK AG 2%/12-14.11.2017	365 000			365 000	377 775.00	0.10
2.75	ERSTE GROUP BANK 2.75%/07-10.12.2015	580 000		580 000			
3.25	ERSTE GROUP BANK 3.25%/07-10.07.2017	270 000			270 000	282 690.00	0.08
3.5	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.5%/11-13.04.2016	100 000		100 000			
1.125	EXPORT-IMPORT BK KOREA 1.125%/14-03.09.2019	180 000			180 000	187 200.00	0.05
2.125	F.VAN LANSCHOT BANKIERS 2.125%/12-04.04.2016	425 000		425 000			
3	FIRST GULF BANK 3%/11-16.02.2016	280 000		280 000			
2	FIRSTSTRAND BANK 2%/14-28.05.2019	200 000			200 000	203 000.00	0.05
1.25	GOLDMAN SACHS GROUP 1.25%/14-11.09.2019	350 000			350 000	364 525.00	0.10
1.5	GOLDMAN SACHS GROUP 1.5%/12-29.11.2018	610 000			610 000	635 315.00	0.17
1.625	GOLDMAN SACHS GROUP S. -F- 1.625%/13-06.02.2020	600 000	440 000		1 040 000	1 103 440.00	0.29
2.5	HETA ASSET RESOLUTION 2.5%/05-13.06.2016	330 000		330 000			
1.875	HSBC BANK 1.875%/10-01.09.2016	170 000			170 000	173 842.00	0.05
2.375	HSBC BANK 2.375%/11-04.04.2018	1 320 000			1 320 000	1 404 480.00	0.38
2.75	HSBC BANK 2.75%/07-03.04.2017	450 000			450 000	471 375.00	0.13
3.25	HSBC FINANCE 3.25%/06-14.07.2016	1 320 000			1 320 000	1 359 600.00	0.36
2	HSBC SFH FRANCE 2%/10-23.04.2019	320 000			320 000	346 400.00	0.09
2.375	HSBC SFH FRANCE 2.375%/10-07.09.2018	200 000			200 000	216 400.00	0.06
3	HSB NORDBANK 3%/07-14.06.2019	400 000	150 000		550 000	618 200.00	0.17
2.25	HYPOTHEKENBANK 2.25%/05-02.08.2017	745 000			745 000	767 350.00	0.21
2.875	HYPOTHEKENBANK 2.875%/07-22.02.2016	275 000		275 000			
2.375	HYPOTHEKENBANK 2.375%/05-21.03.2017	850 000		850 000			
2.375	HYPOTHEKENBANK 2.375%/06-13.09.2017	410 000		410 000			
3.375	HYPOTHEKENBANK FRANKFURT 3.375%/07-07.01.2016	620 000		620 000			
1	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA 1%/14-17.12.	750 000			750 000	753 375.00	0.20
1	ING BANK 1%/13-14.09.2018	1 280 000		900 000	380 000	391 210.00	0.10
1.875	ING BANK 1.875%/10-29.08.2018	350 000	250 000		600 000	639 600.00	0.17
2.125	ING BANK 2.125%/10-07.10.2016	690 000			690 000	705 594.00	0.19
2.625	ING BANK 2.625%/11-23.03.2021	190 000			190 000	218 595.00	0.06
2	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2%/05-15.12.2016	500 000			500 000	513 750.00	0.14
2.25	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2.25%/09-07.11.2017	700 000			700 000	736 400.00	0.20
3.25	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 3.25%/07-28.06.2024	390 000			390 000	470 145.00	0.13
0.5	JP MORGAN CHASE 0.5%/15-04.12.2023		1 500 000		1 500 000	1 485 000.00	0.40
1.125	JPMORGAN CHASE 1.125%/14-06.11.2020	650 000			650 000	680 225.00	0.18
2.25	KFW 2.25%/10-12.08.2020	380 000	670 000		1 050 000	1 193 850.00	0.32
2.5	KFW 2.5%/05-25.08.2025	2 840 000	200 000		3 040 000	3 758 960.00	1.00
2.75	KFW 2.75%/07-16.02.2037	440 000	200 000		640 000	916 480.00	0.24
2.75	KFW 2.75%/09-11.10.2018	580 000		580 000			
3.375	KFW 3.375%/07-30.08.2017	900 000		900 000			
0.875	KIWI BANK 0.875%/14-04.04.2019	400 000			400 000	411 600.00	0.11
1	KIWI BANK 1%/13-23.12.2020	560 000			560 000	592 480.00	0.16
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-15.03.2017	660 000			660 000	663 300.00	0.18
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-26.08.2020	250 000			250 000	250 000.00	0.07
2.5	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.5%/06-14.02.2022	740 000			740 000	728 530.00	0.19
3.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 3.375%/06-22.06.2026	770 000			770 000	776 545.00	0.21
2.5	KOMMUNINVEST I SVERIGE 2.5%/09-04.12.2015	1 170 000		1 170 000			

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.625	KOMMUNINVEST I SVERIGE 2.625%/07-07.12.2016	210 000			210 000	218 442.00	0.06
1.25	KOMMUNINVEST I SVERIGE AB 1.25%/12-28.02.2022	305 000	300 000		605 000	657 937.50	0.18
1.5	KOREA DEVELOPMENT BANK 1.5%/12-23.05.2016	530 000		530 000			
2	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 2%/10-01.10.20	200 000			200 000	221 500.00	0.06
2.875	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.875%/04-30.12.2015	130 000		130 000			
3	LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN 3%/04-29.12.2015	150 000		150 000			
2.125	LANDESKREDITBANK BADEN-WUERTTEMBERG-FOERDERBANK 2.	100 000		100 000			
0.875	LANDSHYPOTEK 0.875%/14-16.09.2024	410 000			410 000	423 120.00	0.11
2.625	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.625%/09-07.07.2016	80 000		80 000			
1.75	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 1.75%/10-16.01.2017	700 000			700 000	722 260.00	0.19
2.125	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.125%/05-29.08.201	560 000			560 000	590 520.00	0.16
0.625	MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023	300 000	250 000		550 000	548 075.00	0.15
2.125	MACQUARIE BANK 2.125%/12-29.11.2018	810 000			810 000	860 220.00	0.23
3	MACQUARIE BANK 3%/12-09.08.2017	780 000			780 000	824 070.00	0.22
3	MACQUARIE BANK 3%/12-29.11.2022	365 000			365 000	424 130.00	0.11
0.35	NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.35%/15-05.08.2022		400 000		400 000	399 800.00	0.11
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/13-17.04.2020	645 000			645 000	674 347.50	0.18
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/14-10.12.2021	1 140 000			1 140 000	1 200 990.00	0.32
1.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.125%/12-07.11.2018	1 020 000			1 020 000	1 056 210.00	0.28
1.5	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.5%/14-07.02.2024	290 000	100 000		390 000	435 045.00	0.12
1.625	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.625%/13-05.09.2023	230 000	100 000		330 000	363 495.00	0.10
2.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.125%/11-03.02.2017	240 000			240 000	247 440.00	0.07
2.25	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.25%/10-14.07.2017	200 000			200 000	208 600.00	0.06
1	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 1%/12-01.02.2018	800 000			800 000	831 600.00	0.22
1.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 1.25%/12-09.08.2024	130 000	250 000		380 000	418 190.00	0.11
1.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 1.375%/12-13.09.2027	200 000			200 000	224 600.00	0.06
1.875	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 1.875%/10-03.02.2020	460 000			460 000	509 680.00	0.14
2	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2%/10-10.10.2017	300 000			300 000	316 350.00	0.08
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2.25%/10-03.09.2019	320 000			320 000	355 520.00	0.10
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2.25%/11-24.02.2021	350 000			350 000	399 700.00	0.11
2.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2.375%/05-19.08.2020	630 000	600 000		1 230 000	1 400 970.00	0.37
2.375	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2.375%/06-27.01.2023	1 080 000			1 080 000	1 274 400.00	0.34
2.5	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2.5%/06-27.12.2018	1 960 000			1 960 000	2 160 900.00	0.58
2.625	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 2.625%/07-07.02.2022	840 000			840 000	994 560.00	0.27
3.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 3.25%/06-07.08.2029	700 000	450 000		1 150 000	1 588 150.00	0.42
3	NIBC BANK 3%/13-19.12.2016	300 000			300 000	309 450.00	0.08
2.625	NIEDEROESTERREICHISCHE LHB 2.625%/06-07.02.2017	1 190 000			1 190 000	1 226 890.00	0.33
3.125	NORD/LB COVERED FINANCE BANK 3.125%/07-17.12.2015	230 000		230 000			
0.55	NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025		500 000	500 000			
0.75	NORDEA BANK 0.75%/14-04.10.2019	500 000			500 000	515 000.00	0.14
0.875	NORDEA BANK 0.875%/13-25.09.2018	860 000			860 000	883 650.00	0.24
1.125	NORDEA BANK 1.125%/12-02.10.2020	1 120 000			1 120 000	1 180 480.00	0.32
1.5	NORDEA BANK 1.5%/12-29.09.2017	1 200 000			1 200 000	1 239 000.00	0.33
2.75	NORDEA BANK 2.75%/11-22.03.2021	410 000			410 000	471 090.00	0.13
2.25	NORDEA BANK AB 2.25%/10-06.05.2016	140 000		140 000			
1.875	NORDEA HYPOTEK 1.875%/10-07.06.2016	400 000		400 000			
1.125	NV BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN BNG 1.125%/12-13.09.	400 000			400 000	435 000.00	0.12
1.125	NV BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN BNG 1.125%/13-19.04.	130 000			130 000	141 310.00	0.04
1.75	NYKREDIT BANK 1.75%/12-26.09.2016	480 000			480 000	488 448.00	0.13
2.5	OBEROESTERREICHISCHE LB 2.5%/06-20.06.2017	1 470 000			1 470 000	1 514 100.00	0.40
1	OEKB 1%/12-28.09.2021	690 000	200 000	690 000	200 000	214 400.00	0.06
1.125	OEKB 1.125%/12-24.05.2018	400 000			400 000	417 800.00	0.11
1.75	OEKB 1.75%/11-14.06.2017	550 000			550 000	572 000.00	0.15
1.75	OEKB 1.75%/12-24.05.2023	440 000			440 000	498 080.00	0.13
2.125	OEKB 2.125%/05-18.10.2018	1 330 000			1 330 000	1 438 395.00	0.38
2.125	OEKB 2.125%/11-23.07.2019	200 000			200 000	220 000.00	0.06
2.625	OEKB 2.625%/06-22.11.2024	1 190 000			1 190 000	1 457 155.00	0.39
2.75	OEKB 2.75%/05-28.01.2020	590 000			590 000	674 075.00	0.18
2.875	OEKB 2.875%/05-25.02.2030	2 765 000			2 765 000	3 680 215.00	0.98
3	OEKB 3%/07-14.06.2022	720 000			720 000	871 560.00	0.23
3.25	OEKB 3.25%/06-25.07.2036	550 000			550 000	827 750.00	0.22
1.125	OEKBOESTERREICHISCHE KONTROLLBANK 1.125%/13-24.07.	1 500 000			1 500 000	1 611 000.00	0.43
1	POHJOLA BANK 1%/14-14.07.2021	400 000	700 000		1 100 000	1 158 300.00	0.31
3.125	PRINCIPAL FINANCIAL GLOBAL FUNDING 3.125%/06-29.06	85 000		85 000			
1.25	RABOBANK 1.25%/12-15.10.2020	250 000			250 000	264 000.00	0.07
2	RABOBANK 2%/10-16.09.2021	900 000			900 000	995 850.00	0.27
2	RABOBANK 2%/11-31.01.2018	350 000			350 000	367 500.00	0.10
2	RABOBANK 2%/12-06.02.2019	600 000			600 000	641 100.00	0.17
2.125	RABOBANK 2.125%/05-11.10.2017	770 000			770 000	806 575.00	0.22
3	RABOBANK 3%/09-10.06.2016	300 000		300 000			
3.125	RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026	2 830 000		200 000	2 630 000	3 311 170.00	0.89
3.5	RABOBANK 3.5%/07-31.08.2023	410 000			410 000	508 400.00	0.14
3.625	RABOBANK 3.625%/09-02.07.2019	370 000			370 000	420 875.00	0.11
1	RABOBANK NEDERLAND 1%/13-26.06.2020	150 000	200 000		350 000	365 225.00	0.10
1.125	RABOBANK NEDERLAND 1.125%/14-08.04.2021	500 000			500 000	526 250.00	0.14
1	RAIFFEISEN LANDESBANK NIEDEROESTERREICH-WIEN 1%/12	860 000			860 000	888 380.00	0.24
1	RAIFFEISEN LANDESBANK NIEDEROESTERREICH 1%/12-07.11.2	470 000			470 000	463 232.00	0.12
0.625	ROYAL BANK OF CANADA 0.625%/14-09.04.2019	400 000			400 000	409 400.00	0.11
2.25	ROYAL BANK OF CANADA 2.25%/11-21.04.2021	1 630 000	430 000		2 060 000	2 341 190.00	0.63
0.75	ROYAL BK CANADA TORONTO BRANCH 0.75%/13-23.10.2018	2 140 000			2 140 000	2 191 360.00	0.59
0.875	SOCIETE GENERALE 0.875%/13-19.06.2018	200 000			200 000	204 500.00	0.05
2.375	SOCIETE GENERALE 2.375%/12-19.09.2022	150 000			150 000	166 875.00	0.04
0.875	SPAREBANK 1 SR BANK 0.875%/13-30.11.2018	760 000			760 000	778 620.00	0.21
0.875	SPAREBANK 1 SR BANK 0.875%/14-02.12.2020	600 000			600 000	619 800.00	0.17
2	STADSHYPOTEK 2%/10-01.12.2016	690 000		240 000	450 000	464 400.00	0.12
3.375	STATE BANK OF INDIA 3.375%/11-22.02.2016	470 000		470 000			
0.625	SVENSKA HANDELSBANKEN 0.625%/14-11.12.2018	940 000			940 000	962 090.00	0.26
1.25	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/13-20.12.2019	700 000			700 000	737 450.00	0.20
1.375	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.375%/12-05.10.2022	625 000			625 000	677 500.00	0.18
2.75	UBS JERSEY BRANCH (subordinated) 2.75%/06-28.04.20	190 000		190 000			
1.375	VORARLBERGER LANDES UND HYPOTHEKENBANK 1.375%/13-2	1 955 000			1 955 000	1 937 405.00	0.52

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.375	VORARLBERGER LHB 2.375%/06-09.08.2017	1 560 000			1 560 000	1 613 040.00	0.43
2.5	VORARLBERGER LHB 2.5%/05-15.02.2016	300 000		300 000			
3.15	VTB CAPITAL 3.15%/12-16.12.2016	1 610 000		1 610 000			
0.625	WELLS FARGO & CO 0.625%/14-03.09.2020	900 000			900 000	919 800.00	0.25
1.25	WELLS FARGO & CO 1.25%/14-03.09.2024	300 000			300 000	318 750.00	0.09
0.4	WESTPAC BANKING 0.40%/15-09.06.2023		200 000		200 000	200 400.00	0.05
0.5	WESTPAC BANKING 0.5%/15-02.02.2022	550 000	100 000		650 000	663 000.00	0.18
2	WESTPAC BANKING 2%/11-15.12.2016	350 000			350 000	359 240.00	0.10
2.5	WESTPAC BANKING 2.5%/10-16.02.2017	180 000			180 000	186 660.00	0.05
3.125	WESTPAC BANKING 3.125%/09-21.12.2018	610 000			610 000	672 220.00	0.18
0.625	WESTPAC SECURITIES NZ - LONDON BRANCH 0.625%/14-02	400 000	500 000		900 000	923 400.00	0.25
						174 742 992.00	46.71
Baugewerbe und -material							
2.25	BORAL 2.25%/13-20.02.2020	750 000			750 000	789 750.00	0.21
3.375	HOLCIM OVERSEAS FINANCE 3.375%/11-10.06.2021	760 000			760 000	889 580.00	0.24
2.125	VINCI 2.125%/11-15.12.2017	450 000			450 000	471 150.00	0.13
3	VINCI 3%/12-24.01.2022	100 000			100 000	114 450.00	0.03
						2 264 930.00	0.61
Bergbau, Kohle und Stahl							
0.75	MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO SAPI DE CV 0.75%/14	280 000			280 000	282 240.00	0.08
						282 240.00	0.08
Computer und Netzwerkausrüster							
0.375	APPLE 0.375%/15-25.11.2024	2 100 000			2 100 000	2 111 550.00	0.56
0.75	APPLE 0.75%/15-25.02.2030	2 100 000		450 000	1 650 000	1 657 425.00	0.44
						3 768 975.00	1.01
Detailhandel und Warenhäuser							
1.5	AUCHAN 1.5%/14-03.06.2024	350 000			350 000	368 025.00	0.10
1.875	METRO 1.875%/12-02.05.2016	400 000		400 000			
						368 025.00	0.10
Diverse Dienstleistungen							
0.75	KOREA DISTRICT HEATING 0.75%/13-20.12.2016	100 000			100 000	100 740.00	0.03
						100 740.00	0.03
Elektrische Geräte und Komponenten							
1.625	GECC 1.625%/12-19.10.2017	1 410 000			1 410 000	1 468 515.00	0.39
2.25	GECC 2.25%/11-19.12.2016	660 000			660 000	680 922.00	0.18
2.5	GECC 2.5%/06-08.02.2018	1 330 000			1 330 000	1 417 780.00	0.38
2.625	GECC 2.625%/10-20.01.2016	500 000		500 000			
2.875	GECC 2.875%/07-27.02.2017	1 080 000			1 080 000	1 132 380.00	0.30
3.125	GECC 3.125%/04-06.12.2019	940 000			940 000	1 062 200.00	0.28
3.375	GECC 3.375%/06-19.06.2018	1 000 000			1 000 000	1 096 500.00	0.29
4.5	GECC 4.5%/08-09.10.2018	320 000			320 000	365 120.00	0.10
3	IBERDROLA INTERNATIONAL 3%/12-13.02.2017	485 000			485 000	505 855.00	0.14
1.625	KOREA WESTERN POWER 1.625%/13-26.03.2019	1 000 000			1 000 000	1 039 500.00	0.28
2.25	SPI AUSTRALIA ASSETS 2.5%/10-09.08.2016	540 000			540 000	550 854.00	0.15
2.625	STATNETT 2.625%/06-15.12.2017	210 000			210 000	222 810.00	0.06
2.375	STATNETT SF S. 30 2.375%/11-08.02.2021	645 000			645 000	724 657.50	0.19
						10 267 093.50	2.74
Elektronik und Halbleiter							
2	LG ELECTRONICS 2%/12-02.12.2016	390 000			390 000	397 488.00	0.11
						397 488.00	0.11
Energie und Wasserversorgung							
2.25	EDF 2.25%/10-29.09.2017	770 000			770 000	805 420.00	0.22
4	EDF 4%/09-27.03.2017	270 000			270 000	286 200.00	0.08
2	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 2%/11-23.12.2015	200 000		200 000			
2.75	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 2.75%/12-17.12.2018	750 000			750 000	809 625.00	0.22
3	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 3%/11-23.06.2020	865 000			865 000	960 582.50	0.26
2.125	GAS NATURAL FINANCE 2.125%/13-08.02.2019	815 000			815 000	863 900.00	0.23
1.125	GDF SUEZ 1.125%/12-09.10.2020	870 000			870 000	912 195.00	0.24
1.5	GDF SUEZ 1.5%/11-20.10.2017	300 000			300 000	309 300.00	0.08
1.625	GDF SUEZ 1.625%/12-09.10.2024	200 000			200 000	219 800.00	0.06
1.5	KEPCO 1.5%/13-23.04.2019	520 000			520 000	539 500.00	0.14
1.125	KOREA GAS 1.125%/13-12.02.2020	1 000 000			1 000 000	1 039 000.00	0.28
2	KOREA GAS 2%/11-11.10.2016	70 000			70 000	71 435.00	0.02
2.25	KOREA GAS CORPORATION 2.25%/10-06.10.2015	200 000		200 000			
3.5	RURAL ELECTRIFICATION 3.5%/12-07.03.2017	50 000			50 000	51 425.00	0.01
						6 868 382.50	1.84
Erdöl							
3	BHARAT PETROLEUM 3%/14-20.12.2019	350 000			350 000	377 125.00	0.10
2.875	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO 2.875%/13-05.12.2018	700 000			700 000	733 250.00	0.20
1.625	KOREA NATIONAL OIL 1.625%/13-29.11.2018	400 000			400 000	416 000.00	0.11
1.875	KOREA NATIONAL OIL 1.875%/12-08.03.2017	670 000			670 000	687 420.00	0.18
2.625	KOREA NATIONAL OIL 2.625%/11-12.05.2016	350 000		350 000			
2.5	PETROLEOS MEXICANOS 2.5%/12-10.04.2019	1 180 000			1 180 000	1 250 800.00	0.33
1.125	SPI ELECTRICITY & GAS 1.125%/12-18.04.2019	630 000			630 000	652 050.00	0.17
1.5	SPI ELECTRICITY & GAS 1.5%/12-21.02.2017	200 000			200 000	204 400.00	0.05
2.375	TOTAL CAPITAL 2.375%/06-13.01.2016	530 000		530 000			
3.125	TOTAL CAPITAL 3.125%/06-28.06.2018	1 570 000		400 000	1 170 000	1 278 810.00	0.34
3.125	TOTAL CAPITAL 3.125%/07-29.09.2015	40 000		40 000			
1	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 1%/14-29.08.2024	1 300 000	200 000		1 500 000	1 569 000.00	0.42
						7 168 855.00	1.92
Fahrzeuge							
2.875	TOYOTA MOTOR CREDIT 2.875%/06-20.09.2016	1 430 000		1 430 000			
						0.00	0.00
Flugzeug- und Raumfahrtindustrie							
2.595	TELEFONICA EMISIONES 2.595%/13-23.10.2020	400 000			400 000	441 600.00	0.12
						441 600.00	0.12
Gastgewerbe und Freizeiteinrichtungen							
1.75	ACCOR 1.75%/14-27.06.2022	250 000			250 000	263 250.00	0.07
1.875	MCDONALD'S 1.875%/10-23.06.2016	285 000			285 000	289 731.00	0.08
						552 981.00	0.15

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Gemeinnützige, öffentlich-rechtliche Institutionen						
1.5 AKADEMISKA HUS 1.5%/11-20.04.2016	440 000		440 000			
2.125 AKADEMISKA HUS 2.125%/10-04.07.2018	710 000			710 000	763 605.00	0.20
2.25 AKADEMISKA HUS 2.25%/11-22.02.2021	150 000			150 000	170 025.00	0.05
2.375 CADES 2.375%/11-19.04.2023	100 000			100 000	118 050.00	0.03
3 CADES 3%/09-21.04.2021	320 000			320 000	376 320.00	0.10
2.5 CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 2.5%/11	970 000			970 000	1 184 370.00	0.32
2.125 KOMMUNEKREDIT 2.125%/11-09.10.2020	365 000			365 000	412 085.00	0.11
2.25 KOMMUNEKREDIT 2.25%/10-16.08.2019	150 000			150 000	166 350.00	0.04
2.625 KOMMUNEKREDIT 2.625%/06-17.10.2016	295 000			295 000	305 531.50	0.08
2.875 KOMMUNEKREDIT 2.875%/06-13.10.2031	2 110 000			2 110 000	2 905 470.00	0.78
3.25 KOMMUNEKREDIT 3.25%/08-08.05.2018	440 000			440 000	485 320.00	0.13
1 KOREA DEVELOPMENT BANK 1%/12-29.10.2018	1 660 000			1 660 000	1 702 330.00	0.46
2.125 KOREA LAND & HOUSING CORPORATION 2.125%/11-12.12.2	150 000			150 000	153 885.00	0.04
3.25 SCNF RESEAU 3.25%/06-30.06.2032	420 000			420 000	595 140.00	0.16
2.625 SNCF RESEAU 2.625%/11-11.03.2037	300 000			300 000	413 550.00	0.11
					9 752 031.50	2.61
Holding- und Finanzgesellschaften						
1.5 ACHMEA 1.5%/13-19.06.2019	450 000			450 000	470 925.00	0.13
0.875 ASB FINANCE LONDON 0.875%/13-11.06.2019	1 390 000			1 390 000	1 437 955.00	0.38
2.125 ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH 2.125%/10-17.11.2016	100 000			100 000	102 590.00	0.03
1.375 ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH S. 2 1.375%/12-02.11	200 000			200 000	209 700.00	0.06
0.625 BATELCO INTERNATIONAL FINANCE 0.625%/14-08.09.2021	600 000			600 000	615 300.00	0.16
3 BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL NETHERLANDS 3%/14-31.0	450 000	250 000		700 000	749 000.00	0.20
1.75 BMW FINANCE 1.75%/11-29.09.2017	890 000			890 000	923 375.00	0.25
1.125 BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.125%/12-20.09.2019	150 000			150 000	156 450.00	0.04
1.375 BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.375%/14-03.02.2021	740 000			740 000	788 100.00	0.21
1.5 BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.5%/12-22.01.2018	535 000			535 000	554 527.50	0.15
0.75 BP CAPITAL MARKETS 0.75%/14-27.09.2021	990 000			990 000	1 019 205.00	0.27
1 BP CAPITAL MARKETS 1%/14-28.08.2020	810 000	600 000	320 000	1 090 000	1 139 595.00	0.30
3 BP CAPITAL MARKETS 3%/07-14.06.2017	100 000		100 000			
1.375 CHINA CONSTRUCTION BANK 1.375%/14-28.05.2019	700 000			700 000	710 500.00	0.19
1 CS GROUP FUNDING 1%/15-14.04.2023		2 000 000		2 000 000	1 996 000.00	0.53
1.625 DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE 1.625%/11-12.10.2016	150 000		150 000			
0.75 DEUTSCHE BAHN FINANCE 0.75%/12-21.08.2017	120 000			120 000	122 580.00	0.03
1.375 DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.375%/13-24.07.2023	1 010 000			1 010 000	1 106 960.00	0.30
1.5 DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/11-18.12.2017	1 290 000			1 290 000	1 346 760.00	0.36
1.5 DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/12-21.02.2024	190 000			190 000	209 285.00	0.06
1.5 DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/14-26.08.2024	440 000			440 000	485 980.00	0.13
1.75 DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.75%/10-03.06.2020	1 420 000	200 000		1 620 000	1 769 850.00	0.47
0.5 EBN 0.5%/14-22.09.2022	490 000	100 000		590 000	610 060.00	0.16
0.625 EBN 0.625%/12-04.07.2019	40 000			40 000	41 240.00	0.01
0.75 EBN 0.75%/11-03.10.2016	370 000		370 000			
0.875 EBN 0.875%/14-22.09.2026	650 000	200 000		850 000	891 225.00	0.24
1.125 EBN 1.125%/12-04.07.2024	210 000	100 000		310 000	337 125.00	0.09
1.625 EBN 1.625%/11-03.10.2023	120 000			120 000	134 160.00	0.04
2.125 EBN 2.125%/10-27.04.2020	770 000			770 000	849 695.00	0.23
1.25 ENBW INTERNATIONAL FINANCE 1.25%/13-12.07.2018	1 150 000			1 150 000	1 187 375.00	0.32
4 ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4%/12-26.10.2027	200 000			200 000	247 100.00	0.07
2.625 EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.625%/09-24.07.2017	770 000		770 000			
1.25 FONDO MIVIVIENDA 1.25%/14-13.06.2018	350 000			350 000	357 350.00	0.10
2.85 GAZ CAPITAL 2.85%/13-25.10.2019	1 000 000		1 000 000			
2.75 GIC FUNDING 2.75%/12-16.11.2015	250 000		250 000			
1.25 GLENCORE FINANCE 1.25%/14-01.12.2020	1 370 000			1 370 000	1 345 340.00	0.36
2.125 GLENCORE FINANCE 2.125%/13-23.12.2019	790 000			790 000	809 750.00	0.22
2.625 GLENCORE FINANCE 2.625%/12-03.12.2018	910 000			910 000	950 950.00	0.25
3.625 GLENCORE FINANCE 3.625%/10-06.04.2016	1 490 000		1 490 000			
0.5 HYUNDAI CAPITAL SERVICES 0.5%/14-20.10.2017	400 000			400 000	401 000.00	0.11
2.5 HYUNDAI CAPITAL SERVICES 2.5%/12-15.02.2017	120 000			120 000	124 020.00	0.03
2.25 LEASEPLAN 2.25%/12-18.07.2016	200 000			200 000	203 820.00	0.05
2.375 LEASEPLAN 2.375%/12-15.10.2020	300 000			300 000	325 950.00	0.09
2.5 LGT FINANCE 2.5%/10-12.05.2017	110 000			110 000	114 620.00	0.03
2.75 LGT FINANCE 2.75%/09-08.12.2016	650 000			650 000	673 400.00	0.18
0.75 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.75%/14-1704.201	580 000			580 000	595 660.00	0.16
1 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 1%/14-19.09.2022	1 200 000			1 200 000	1 250 400.00	0.33
1.125 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 1.125%/13-18.06	200 000			200 000	209 600.00	0.06
3.125 MORGAN STANLEY 3.125%/06-21.11.2018	920 000			920 000	1 010 160.00	0.27
0.75 MUNICIPALITY FINANCE 0.75%/14-17.09.2024	830 000	250 000		1 080 000	1 138 320.00	0.30
0.875 MUNICIPALITY FINANCE 0.875%/13-01.02.2023	100 000			100 000	106 700.00	0.03
1.375 MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027	500 000			500 000	562 000.00	0.15
2.875 NEDERLANDSE FINANCIERINGS-MAATSCHAPPIJ VOOR ONTWIK	400 000		400 000			
2.375 NEW YORK LIFE FUNDING 2.375%/06-22.02.2016	610 000		610 000			
0.375 NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.375%/15-02.02.2022	1 300 000	100 000		1 400 000	1 418 200.00	0.38
0.5 NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.5%/14-13.05.2019	100 000			100 000	101 350.00	0.03
2.536 PKO FINANCE 2.536%/12-21.12.2015	720 000		720 000			
3.538 PKO FINANCE 3.538%/11-07.07.2016	300 000		300 000			
0.5 QNB FINANCE LTD 0.5%/13-27.06.2016	300 000			300 000	300 780.00	0.08
1.5 RCI BANQUE 1.50%/13-19.07.2016	120 000			120 000	121 548.00	0.03
2.065 SB CAPITAL 2.065%/13-28.02.2017	670 000		670 000			
2.125 SCBC 2.125%/10-15.02.2017	100 000			100 000	103 800.00	0.03
0.375 SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.375%/15-21.08.2023		1 400 000		1 400 000	1 403 500.00	0.38
0.875 SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.875%/15-21.08.2028		1 200 000		1 200 000	1 201 200.00	0.32
2.125 SWEDISH COVERED BOND CORPORATION 2.125%/09-08.06.2	230 000			230 000	234 715.00	0.06
1.25 SWEDISH EXPORT CREDIT 1.25%/13-17.07.2023	790 000			790 000	865 840.00	0.23
1.875 SWEDISH EXPORT CREDIT 1.875%/10-08.03.2017	180 000			180 000	186 750.00	0.05
2.625 SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/07-09.02.2017	700 000			700 000	732 550.00	0.20
2.625 SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/09-28.12.2015	420 000		420 000			
3 SWEDISH EXPORT CREDIT 3%/09-27.02.2018	260 000			260 000	283 010.00	0.08
3.375 UNICREDIT BANK IRELAND 3.375%/12-25.10.2017	2 150 000			2 150 000	2 296 200.00	0.61
3.875 WUERTH FINANCE INTERNATIONAL 3.875%/09-03.08.2015	40 000		40 000			
					39 641 100.50	10.60

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Immobilien						
2.125 BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 2.125%/05-12.	220 000			220 000	236 170.00	0.06
3.125 BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.125%/06-01.	220 000			220 000	294 580.00	0.08
3.25 BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/07-16.0	460 000			460 000	519 800.00	0.14
3.25 BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/08-02.1	220 000			220 000	237 050.00	0.06
2.5 MFINANCE FRANCE 2.5%/13-08.10.2018	800 000			800 000	817 600.00	0.22
2 UNIBAIL-RODAMCO 2%/13-20.11.2023	290 000			290 000	326 105.00	0.09
					2 431 305.00	0.65
Kantone, Bundesstaaten, Provinzen						
2.75 BERLIN 2.75%/07-03.05.2017	420 000			420 000	443 730.00	0.12
2.875 BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.11.2018	1 330 000			1 330 000	1 478 960.00	0.40
2.875 BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.12.2017	880 000			880 000	950 400.00	0.25
1.625 ILE DE FRANCE 1.625%/10-08.12.2017	250 000			250 000	261 625.00	0.07
2.375 ILE DE FRANCE 2.375%/05-28.12.2016	370 000			370 000	383 875.00	0.10
3.25 ILE DE FRANCE 3.25%/07-27.11.2018	1 280 000			1 280 000	1 431 040.00	0.38
0.375 LAND NIEDEROESTERREICH 0.375%/14-27.04.2021	240 000			240 000	243 480.00	0.07
2.125 LAND NIEDEROESTERREICH 2.125%/10-15.08.2017	1 940 000			1 940 000	2 031 180.00	0.54
1.375 MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/10-08.10.2015	160 000		160 000			
1.625 MUNICIPALITY FINANCE 1.625%/11-07.02.2018	960 000			960 000	1 012 800.00	0.27
1.75 MUNICIPALITY FINANCE 1.75%/10-26.05.2017	370 000			370 000	384 985.00	0.10
2.25 MUNICIPALITY FINANCE 2.25%/10-10.12.2019	460 000			460 000	513 590.00	0.14
2.375 MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/09-11.03.2016	670 000		670 000			
2.375 MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/11-30.03.2026	100 000			100 000	122 600.00	0.03
3 MUNICIPALITY FINANCE 3%/09-15.04.2021	145 000			145 000	171 897.50	0.05
2.25 NORDRHEIN-WESTFALEN 2.25%/06-01.03.2019	640 000			640 000	701 760.00	0.19
3.25 NORDRHEIN-WESTFALEN 3.25%/07-28.08.2015	140 000		140 000			
2.875 PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 2.875%/09-04.03.2016	540 000		540 000			
2.375 PROVINCE OF ONTARIO 2.375%/10-07.05.2020	320 000	325 000		645 000	728 850.00	0.19
2.5 PROVINCE OF ONTARIO 2.5%/09-04.12.2019	1 670 000			1 670 000	1 880 420.00	0.50
3.375 PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-01.12.2015	360 000		360 000			
3.375 PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-27.05.2016	400 000		400 000			
3.375 PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/09-29.04.2019	130 000			130 000	148 395.00	0.04
3.75 PROVINCE OF ONTARIO 3.75%/08-30.07.2018	590 000		590 000			
1.5 PROVINCE OF QUEBEC 1.5%/14-05.02.2024	730 000			730 000	812 490.00	0.22
0.75 QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024	490 000			490 000	514 255.00	0.14
1.125 QUEBEC 1.125%/13-22.02.2023	1 050 000			1 050 000	1 130 850.00	0.30
2.625 QUEBEC 2.625%/06-21.06.2017		150 000		150 000	158 625.00	0.04
2.875 QUEBEC 2.875%/09-17.12.2021	350 000			350 000	418 075.00	0.11
3.375 QUEBEC 3.375%/08-19.01.2018	1 910 000			1 910 000	2 088 585.00	0.56
3.875 QUEBEC 3.875%/09-11.12.2018	100 000			100 000	114 300.00	0.03
2.125 SASKATCHEWAN 2.125%/05-15.01.2016	700 000		700 000			
1.625 STATE OF HESSE 1.625%/10-29.09.2016	210 000			210 000	214 872.00	0.06
3.125 STATE OF HESSEN 3.125%/08-30.10.2015	120 000		120 000			
3.25 STATE OF HESSEN 3.25%/08-22.05.2017	810 000			810 000	864 270.00	0.23
					19 205 909.50	5.13
Länder und Zentralregierungen						
2.5 AUSTRIA 2.5%/09-14.07.2016	840 000			840 000	861 924.00	0.23
1.125 CHILE 1.125%/13-23.05.2018	600 000			600 000	613 800.00	0.16
1.125 CHILE 1.125%/13-25.07.2017	100 000			100 000	101 900.00	0.03
2.875 CZECH REPUBLIC 2.875%/09-23.11.2016	1 360 000			1 360 000	1 413 448.00	0.38
2.5 ITALY 2.5%/06-30.01.2018	2 070 000			2 070 000	2 190 060.00	0.59
POLAND 0%/15-08.05.2018		500 000		500 000	501 000.00	0.13
1 POLAND 1%/14-17.09.2021	850 000	1 000 000		1 850 000	1 936 950.00	0.52
2.25 POLAND 2.25%/12-15.05.2018	850 000			850 000	905 250.00	0.24
2.75 POLAND 2.75%/11-25.02.2016	790 000		790 000			
3.25 POLAND 3.25%/07-15.05.2019	2 245 000			2 245 000	2 518 890.00	0.67
3.625 POLAND 3.625%/08-21.04.2017	150 000			150 000	159 375.00	0.04
1.375 SLOVAKIA 1.375%/13-16.10.2019	1 180 000			1 180 000	1 250 210.00	0.33
2.125 SLOVAKIA 2.125%/12-25.04.2018	1 270 000			1 270 000	1 353 820.00	0.36
2.125 SLOVAKIA 2.125%/13-16.10.2023	100 000			100 000	113 450.00	0.03
2.75 SLOVAKIA 2.75%/12-25.04.2022	450 000			450 000	523 800.00	0.14
					14 443 877.00	3.86
Nahrungsmittel und Softdrinks						
4.125 DANONE FINANCE 4.125%/08-20.06.2016	110 000		110 000			
0.625 MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625%/15-30.12.2021		1 050 000		1 050 000	1 054 725.00	0.28
1.125 MONDELEZ INTERNATIONAL 1.125%/15-30.12.2025		400 000	230 000	170 000	171 445.00	0.05
2.625 NESTLE HOLDINGS 2.625%/07-14.02.2018	660 000			660 000	708 840.00	0.19
					1 935 010.00	0.52
Pfandbriefinstitute und Refinanzgesellschaften (MBA, ABS)						
0.313 BAVARIAN SKY -A- 0.313%/13-15.05.2016	600 000		600 000			
2 CIF EUROMORTGAGE 2%/10-30.01.2019	750 000	800 000		1 550 000	1 661 600.00	0.44
2.375 CIF EUROMORTGAGE 2.375%/10-05.03.2019	370 000			370 000	402 560.00	0.11
2.125 DEPFA ACS BANK 2.125%/05-13.10.2017	1 265 000			1 265 000	1 309 907.50	0.35
2.375 DEPFA ACS BANK 2.375%/06-15.02.2019	515 000			515 000	548 475.00	0.15
3.25 DEPFA ACS BANK 3.25%/06-31.07.2031	300 000			300 000	366 600.00	0.10
3 DEPFA PFANDBRIEF BANK INTERNATIONAL 3%/06-16.06.20	570 000		570 000			
3.125 DEPFA PFANDBRIEF BANK INTERNATIONAL 3.125%/06-31.08	500 000		500 000			
2.375 DEUTSCHE HYPOTHEKENBANK 2.375%/05-09.12.2015	110 000		110 000			
2.5 DEUTSCHE HYPOTHEKENBANK 2.5%/06-08.03.2018	660 000			660 000	703 890.00	0.19
2.125 DEUTSCHE PFANDBRIEF BANK 2.125%/09-02.11.2016	350 000			350 000	357 805.00	0.10
2.5 DEUTSCHE PFANDBRIEF BANK 2.5%/05-09.03.2017	380 000			380 000	392 920.00	0.11
3.125 EUROHYPO 3.125%/06-14.07.2025	870 000			870 000	1 087 935.00	0.29
2.5 HEATHROW FUNDING C. A 2.5%/12-08.02.2017	760 000			760 000	786 980.00	0.21
2.875 KOMMUNALBANKEN 2.875%/09-09.05.2017	290 000			290 000	306 820.00	0.08
1.5 LANDSHYPOTEK 1.5%/10-13.12.2016	520 000			520 000	532 480.00	0.14
1.5 LANDSHYPOTEK 1.5%/11-24.10.2018	790 000			790 000	836 610.00	0.22
1 LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 1%/12-29.05.2019	610 000			610 000	635 315.00	0.17
1.125 LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB 1.125%/13-11.04.2023	250 000			250 000	268 875.00	0.07
3 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 3%/07-12.06.2017	740 000			740 000	782 920.00	0.21
2.125 PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.125%/	830 000		830 000			
2.875 PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.875%/	2 050 000		2 050 000			

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2	SBAB BANK 2%/11-06.12.2018	400 000			400 000	424 000.00	0.11
2	SBAB BANK AB 2.0%/11-17.02.2016	780 000		780 000			
1.625	SWEDBANK MORTGAGE 1.625%/10-08.12.2017	300 000			300 000	313 950.00	0.08
2.125	SWEDBANK MORTGAGE 2.125%/10-26.08.2016	330 000			330 000	338 778.00	0.09
2.5	SWEDBANK MORTGAGE 2.5%/11-03.06.2022	990 000			990 000	1 159 290.00	0.31
						13 217 710.50	3.53
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte							
1.5	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.5%/12-25.10.2018	1 190 000		150 000	1 040 000	1 075 880.00	0.29
						1 075 880.00	0.29
Städte, Gemeinden							
1.125	AUCKLAND COUNCIL 1.125%/13-07.02.2024	700 000			700 000	760 200.00	0.20
1.5	AUCKLAND COUNCIL 1.5%/14-28.11.2025	570 000			570 000	643 245.00	0.17
3.25	PARIS 3.25%/08-05.11.2018	120 000			120 000	133 680.00	0.04
						1 537 125.00	0.41
Supranationale Organisationen							
2.625	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.625%/09-25.03.2019	910 000			910 000	1 010 555.00	0.27
2.75	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75%/10-12.02.2030	1 050 000			1 050 000	1 392 825.00	0.37
1.625	BEI 1.625%/12-02.04.2026	530 000			530 000	609 765.00	0.16
1.625	BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK 1.625%/15-20.		450 000		450 000	451 350.00	0.12
2.5	BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK 2.5%/12-04.10	150 000		150 000			
0.5	CABEI T. -A- 0.5%/14-26.11.2018	400 000			400 000	406 800.00	0.11
1.875	CABEI 1.875%/14-25.02.2022	910 000			910 000	997 360.00	0.27
0.625	CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.	100 000			100 000	100 960.00	0.03
1.5	CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 1.5	730 000			730 000	774 895.00	0.21
1.5	CENTRAL AMERICAN BANK OF ECONOMIC INTEGRATION 1.5%	100 000	250 000		350 000	371 700.00	0.10
0.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.5%/15-26.02.2026	250 000			250 000	242 250.00	0.06
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/12-11.09.2018	600 000			600 000	629 700.00	0.17
2.75	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.75%/11-03.02.2017	940 000			940 000	979 010.00	0.26
1.375	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.375%/13-11.02.2021	420 000	1 000 000		1 420 000	1 519 400.00	0.41
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/13-13.08.2020	600 000	200 000		800 000	855 600.00	0.23
1.5	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/14-01.12.2028	800 000	100 000		900 000	969 750.00	0.26
2	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024	700 000			700 000	785 750.00	0.21
3.375	COUNCIL OF EUROPE 3.375%/08-06.11.2020	590 000			590 000	705 935.00	0.19
1	COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 1%/14-06.03.202	450 000			450 000	483 750.00	0.13
1.125	EIB 1.125%/12-26.04.2023	1 000 000			1 000 000	1 090 500.00	0.29
1.25	EIB 1.25%/12-02.08.2019	1 470 000			1 470 000	1 574 370.00	0.42
1.375	EIB 1.375%/13-21.02.2028	2 350 000		500 000	1 850 000	2 100 675.00	0.56
1.5	EIB 1.5%/12-02.08.2024	880 000			880 000	993 520.00	0.27
1.625	EIB 1.625%/11-23.11.2023	1 100 000			1 100 000	1 247 950.00	0.33
1.75	EIB 1.75%/10-21.04.2017		150 000	90 000	60 000	62 310.00	0.02
1.75	EIB 1.75%/13-28.06.2033	590 000			590 000	719 800.00	0.19
2	EIB 2%/10-24.08.2022	510 000	150 000		660 000	759 330.00	0.20
2.125	EIB 2.125%/10-22.01.2020	1 110 000			1 110 000	1 240 980.00	0.33
2.375	EIB 2.375%/05-10.07.2020	2 680 000	400 000		3 080 000	3 508 120.00	0.94
2.5	EIB 2.5%/07-08.02.2019	1 820 000	150 000		1 970 000	2 182 760.00	0.58
2.625	EIB 2.625%/10-11.02.2025	520 000			520 000	642 980.00	0.17
3	EIB 3%/09-14.04.2021	460 000			460 000	546 940.00	0.15
3.125	EIB 3.125%/06-30.06.2036	1 120 000	100 000		1 220 000	1 836 100.00	0.49
3.25	EIB 3.25%/08-30.04.2018	500 000		500 000			
3.375	EIB 3.375%/07-15.10.2027	1 140 000	100 000		1 240 000	1 697 560.00	0.45
1.625	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/14-040225	665 000			665 000	760 427.50	0.20
2.75	IADB 2.75%/09-15.04.2019	1 050 000			1 050 000	1 179 150.00	0.32
	IBRD 0%/86-26.11.2021		700 000		700 000	710 150.00	0.19
2.75	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMEN	1 360 000			1 360 000	1 530 000.00	0.41
2.5	NORDIC INVESTMENT BANK 2.5%/09-11.04.2018	380 000		380 000			
						37 670 977.50	10.07
Tabak und alkoholische Getränke							
1.375	BAT HOLDINGS 1.375%/14-08.09.2026	850 000			850 000	901 000.00	0.24
0.75	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 0.75%/ 0.75%/14-16.12.	400 000			400 000	410 000.00	0.11
0.875	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 0.875%/13-11.03.2019	650 000			650 000	667 550.00	0.18
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1%/11-06.12.2016	210 000			210 000	212 625.00	0.06
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1%/12-18.09.2020	625 000			625 000	648 437.50	0.17
1.625	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1.625%/14-16.05.2024	600 000			600 000	656 400.00	0.18
2	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 2%/11-06.12.2021	710 000	100 000		810 000	890 595.00	0.24
						4 386 607.50	1.17
Telekommunikation							
1.125	AMERICA MOVIL 1.125%/12-12.09.2018	900 000			900 000	924 750.00	0.25
2	AMERICA MOVIL 2%/11-27.12.2017	650 000			650 000	679 575.00	0.18
0.5	AT&T 1.875%/14-04.12.2019	400 000		400 000			
1.375	AT&T 1.875%/14-04.12.2024	400 000	350 000	350 000	400 000	417 600.00	0.11
1.875	AT&T 1.875%/14-04.12.2030	2 050 000			700 000	1 480 275.00	0.40
2.25	DEUTSCHE TELEKOM 2.25%/10-08.07.2016	800 000		800 000			
1.625	ORANGE 1.625%/11-13.10.2016	590 000			590 000	601 800.00	0.16
1.75	SK TELECOM 1.75%/12-12.06.2017	300 000			300 000	307 350.00	0.08
2.718	TELEFONICA EMISIONES 2.718%/12-14.12.2018	430 000			430 000	462 035.00	0.12
3.45	TELEFONICA EMISIONES 3.45%/12-14.12.2022	290 000			290 000	346 550.00	0.09
1.75	TELSTRA 1.75%/11-14.12.2018	200 000			200 000	211 000.00	0.06
						5 430 935.00	1.45
Verkehr und Transport							
2.5	AEROPORTS DE PARIS 2.5%/10-27.01.2017	420 000			420 000	436 380.00	0.12
1	KOREA RAILROAD 1%/12-16.11.2018	530 000			530 000	543 250.00	0.15
1.5	KOREA RAILROAD 1.5%/13-02.12.2019	650 000			650 000	677 300.00	0.18
3.638	NATIONAL COMPANY KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY 3.638%/14-	1 100 000		400 000	700 000	658 350.00	0.18
2.75	NETWORK RAIL INFRASTRUCTURE FINANCE 2.75%/06-06.10	780 000			780 000	918 450.00	0.25
1.125	NORWEGIAN RAILWAYS 1.125%/13-02.05.2023	250 000			250 000	265 375.00	0.07
1.375	NORWEGIAN RAILWAYS 1.375%/10-15.11.2017	1 020 000			1 020 000	1 060 800.00	0.28
2.125	NORWEGIAN RAILWAYS 2.125%/11-14.02.2020	180 000			180 000	196 830.00	0.05
2.625	RATP 2.625%/06-06.11.2019	1 540 000			1 540 000	1 712 480.00	0.46
3.375	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARIS 3.375%/08-21.0	200 000		200 000			
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/07-0	640 000			640 000	689 600.00	0.18
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/08-0	100 000			100 000	108 000.00	0.03

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.625	SNCF RESEAU 2.625%/11-10.03.2031	250 000			250 000	323 375.00	0.09
3	SNCF RESEAU 3%/09-24.04.2019	300 000			300 000	336 450.00	0.09
2.25	SNCF MOBILITES 2.25%/11-25.02.2021	590 000			590 000	657 850.00	0.18
2.375	SNCF MOBILITES 2.375%/09-24.07.2019	600 000			600 000	659 100.00	0.18
2.625	SNCF MOBILITES 2.625%/06-13.12.2021	360 000	100 000		460 000	532 910.00	0.14
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-11.06.2018	390 000			390 000	422 175.00	0.11
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-23.01.2019	200 000			200 000	220 200.00	0.06
2	SNCF RESEAU 2%/10-12.11.2026	550 000			550 000	645 975.00	0.17
2.875	SNCF RESEAU 2.875%/09-26.02.2021	410 000			410 000	477 240.00	0.13
						11 542 090.00	3.09
Verpackungsindustrie							
2.125	AMCOR 2.125%/12-04.04.2018	240 000			240 000	252 120.00	0.07
						252 120.00	0.07
Versicherungsgesellschaften							
2.75	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 2.75%/06-21.12.2016	190 000		190 000			
3.375	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 3.375%/07-29.06.2017	190 000		190 000			
3	ASIF III 3%/04-29.12.2015	260 000		260 000			
3.125	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 3.125%/06-27.06	400 000			400 000	411 680.00	0.11
1.125	PACCAR FINANCIAL EUROPE 1.125%/12-06.03.2017	350 000			350 000	355 075.00	0.09
						766 755.00	0.20
Total Obligationen						370 513 736.00	99.04
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						370 513 736.00	99.04
Total Anlagen						370 513 736.00	99.04
Bankguthaben auf Sicht						200 112.68	0.05
Sonstige Vermögenswerte						3 390 400.91	0.91
Gesamtfondsvermögen (GFV)						374 104 249.59	100.00
./. Andere Verbindlichkeiten						16 124.53	0.00
Nettofondsvermögen						374 088 125.06	100.00

¹ Umfassen Käufe und Verkäufe sowie Corporate Actions

Gemäss § 18 des Fondsreglements wurden in der Berichtsperiode folgende Anteile gegen Effekten statt in bar ausgegeben bzw. zurückgenommen:

Klasse	Datum	Anteile	Währung	NAV	Ausgabe	Rücknahme
D	17.08.2015	5 571.302	CHF	1 022.42	x	

Kurze Übersicht

Kennzahlen		31.08.2015	28.02.2015	28.02.2014
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	1 333.7	1 177.2	963.8
Anteilklasse D				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	224.0	138.4	167.8
Inventarwert pro Anteil	CHF	991.09	1 010.88	1 010.08
Anteilklasse F				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	133.2	137.2	98.2
Inventarwert pro Anteil	CHF	991.11	1 010.58	1 009.72
Anteilklasse Z				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	976.5	901.7	697.8
Inventarwert pro Anteil	CHF	991.52	1 011.72	1 010.70

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.08.2015
EURO	1.083600
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000

**Vermögens-
rechnung per
31. August 2015**

	Konsolidierung	
	31.08.2015	28.02.2015
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
– Sichtguthaben	1 117 101.13	10 849 138.21
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 319 114 615.00	1 152 942 905.00
Sonstige Vermögenswerte	13 462 898.52	13 431 225.88
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	1 333 694 614.65	1 177 223 269.09
Andere Verbindlichkeiten	34 609.05	24 521.79
Bankverbindlichkeiten	0.41	0.40
Nettofondsvermögen	1 333 660 005.19	1 177 198 746.90
Anzahl Anteile im Umlauf	1 345 225.118	1 163 826.441

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015	01.03.2014– 28.02.2015
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	1 177 198 746.90	963 761 413.80
Ordentliche Jahresausschüttung / Ablieferung VST	–24 722 757.55	–15 275 685.23
Ausgaben von Anteilen	329 810 207.17	309 898 500.22
Rücknahmen von Anteilen	–149 599 817.17	–98 938 343.99
Sonstiges aus Anteilverkehr	3 804 256.04	578 254.49
Gesamterfolg	–2 830 630.20	17 174 607.61
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 333 660 005.19	1 177 198 746.90
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	1 163 826.441	953 755.456
Ausgegebene Anteile	331 353.456	308 691.091
Zurückgenommene Anteile	–149 954.779	–98 620.106
Bestand am Ende der Berichtsperiode	1 345 225.118	1 163 826.441

Inventarwert pro Anteil
Ausserbilanzgeschäfte

Keine

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
138 354 312.92	167 747 925.43	137 184 657.81	98 167 623.46	901 659 776.17	697 845 864.91
–2 712 174.28	–2 542 020.94	–2 586 120.38	–1 405 368.73	–19 424 462.89	–11 328 295.56
113 105 705.91	37 078 523.59	53 542 802.88	60 428 923.34	163 161 698.38	212 391 053.29
–24 758 509.50	–66 406 667.09	–55 005 322.80	–21 796 845.60	–69 835 984.87	–10 734 831.30
513 270.76	553 908.21	288 906.08	–99 213.68	3 002 079.20	123 559.96
–501 837.40	1 922 643.72	–228 080.03	1 889 539.02	–2 100 712.77	13 362 424.87
224 000 768.41	138 354 312.92	133 196 843.56	137 184 657.81	976 462 393.22	901 659 776.17
136 865.638	166 073.185	135 748.316	97 222.710	891 212.487	690 459.561
113 960.178	36 996.117	53 723.955	60 252.215	163 669.323	211 442.759
–24 810.187	–66 203.664	–55 081.241	–21 726.609	–70 063.351	–10 689.833
226 015.629	136 865.638	134 391.030	135 748.316	984 818.459	891 212.487
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
991.09	1 010.88	991.11	1 010.58	991.52	1 011.72

**Erfolgsrechnung
für die Zeit vom
1. März 2015 bis
zum 31. August
2015**

	Konsolidierung	
	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	0.00	1 934.09
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige		
Forderungswertpapiere und -rechte	12 021 561.67	22 701 885.80
Sonstige Erträge	1 104.18	3 379.40
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	2 115 095.26	3 319 159.89
Total Erträge abzüglich	14 137 761.11	26 026 359.18
Passivzinsen	0.00	5.73
Negativzinsen	5 431.32	0.00
Reglementarische Vergütung an:		
– die Fondsleitung	166 580.52	306 777.78
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	828 713.69	1 222 280.52
Nettoertrag	13 137 035.58	24 497 295.15
Realisierte Kapitalgewinne	635 895.90	326 589.47
Realisierte Kapitalverluste	–7 554 695.96	–6 299 681.75
Realisierter Erfolg	6 218 235.52	18 524 202.87
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	–9 048 865.72	–1 349 595.26
Gesamterfolg	–2 830 630.20	17 174 607.61

Anteilklasse D		Anteilklasse F		Anteilklasse Z	
01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF	01.03.2015– 31.08.2015 CHF	01.03.2014– 28.02.2015 CHF
0.00	318.24	0.00	195.40	0.00	1 420.45
1 529 171.21	3 556 452.31	1 310 356.36	2 347 211.34	9 182 034.10	16 798 222.15
125.63	520.65	121.27	350.92	857.28	2 507.83
825 989.73	214 770.85	315 966.60	727 911.67	973 138.93	2 376 477.37
2 355 286.57	3 772 062.05	1 626 444.23	3 075 669.33	10 156 030.31	19 178 627.80
0.00	0.68	0.00	0.67	0.00	4.38
880.67	0.00	544.31	0.00	4 006.34	0.00
66 238.24	140 574.97	100 342.28	166 202.81	0.00	0.00
145 016.18	835 597.92	287 779.97	218 051.66	395 917.54	168 630.94
2 143 151.48	2 795 888.48	1 237 777.67	2 691 414.19	9 756 106.43	19 009 992.48
79 928.13	170 820.00	197 671.06	51 962.11	358 296.71	103 807.36
–1 240 414.76	–872 960.59	–891 068.29	–748 311.33	–5 423 212.91	–4 678 409.83
982 664.85	2 093 747.89	544 380.44	1 995 064.97	4 691 190.23	14 435 390.01
–1 484 502.25	–171 104.17	–772 460.47	–105 525.95	–6 791 903.00	–1 072 965.14
–501 837.40	1 922 643.72	–228 080.03	1 889 539.02	–2 100 712.77	13 362 424.87

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Obligationen							
Australien							
2.125	AMCOR 2.125%/12-04.04.2018	2 010 000			2 010 000	2 111 505.00	0.16
1.5	ANZ BANKING GROUP 1.5%/12-13.02.2019	1 280 000	3 060 000		4 340 000	4 600 400.00	0.34
2	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2%/10-08.07.	880 000	250 000	1 130 000			
2.625	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 2.625%/11-27	570 000	250 000		820 000	870 430.00	0.07
1.125	BENDIGO & ADEL 1.125%/14-25.03.2019	500 000	2 140 000		2 640 000	2 732 400.00	0.20
1.5	COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA 1.5%/12-13.09.2019	1 600 000	500 000		2 100 000	2 241 750.00	0.17
0.875	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875%/13-11.02.202		300 000		300 000	311 700.00	0.02
1	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1%/13-25.09.2018	2 590 000	2 500 000		5 090 000	5 247 790.00	0.39
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3%/09-09.11.2017	1 120 000	250 000		1 370 000	1 459 735.00	0.11
2.125	MACQUARIE BANK 2.125%/12-29.11.2018	1 250 000	1 000 000		2 250 000	2 389 500.00	0.18
3	MACQUARIE BANK 3%/12-09.08.2017	1 600 000			1 600 000	1 690 400.00	0.13
1	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1%/13-17.04.2020	500 000	540 000		1 040 000	1 087 320.00	0.08
1.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.125%/12-07.11.2018	2 300 000	1 700 000		4 000 000	4 142 000.00	0.31
2.125	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.125%/11-03.02.2017	930 000			930 000	958 830.00	0.07
2.25	NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.25%/10-14.07.2017	1 610 000			1 610 000	1 679 230.00	0.13
2.25	SPI AUSTRALIA ASSETS 2.5%/10-09.08.2016	450 000			450 000	459 045.00	0.03
1.125	SPI ELECTRICITY & GAS 1.125%/12-18.04.2019	1 450 000			1 450 000	1 500 750.00	0.11
1.5	SPI ELECTRICITY & GAS 1.5%/12-21.02.2017	1 190 000			1 190 000	1 216 180.00	0.09
1.75	TELSTRA 1.75%/11-14.12.2018	250 000			250 000	263 750.00	0.02
2	WESTPAC BANKING 2%/11-15.12.2016	2 130 000			2 130 000	2 186 232.00	0.16
2.5	WESTPAC BANKING 2.5%/10-16.02.2017	1 230 000			1 230 000	1 275 510.00	0.10
3.125	WESTPAC BANKING 3.125%/09-21.12.2018	500 000			500 000	551 000.00	0.04
						38 975 457.00	2.92
Bermudas							
3	CBO FINANCE 3%/10-07.12.2015	350 000		350 000			
						0.00	0.00
Brasilien							
2.75	BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONOMICO E SOCI	500 000			500 000	505 250.00	0.04
						505 250.00	0.04
Cayman-Inseln							
3	ABU DHABI COMMERCIAL BANK 3%/11-08.12.2015	200 000		200 000			
2.5	BANCO DO BRASIL CAYMAN 2.5%/13-20.06.2019	1 780 000	2 200 000		3 980 000	3 970 050.00	0.30
1.85	BANCO SAFRA 1.85%/14-27.06.2017	1 000 000			1 000 000	1 010 500.00	0.08
3.25	BANCO SANTANDER BRAZIL S.A. GRAND CAYMAN BRANCH 3.	1 050 000		1 050 000			
2.75	GIC FUNDING 2.75%/12-16.11.2015	400 000		400 000			
2.125	LGT FINANCE 2.125%/11-25.11.2015	220 000		220 000			
2.5	LGT FINANCE 2.5%/10-12.05.2017	1 050 000			1 050 000	1 094 100.00	0.08
2.75	LGT FINANCE 2.75%/09-08.12.2016	870 000			870 000	901 320.00	0.07
2.375	NEW YORK LIFE FUNDING 2.375%/06-22.02.2016	3 360 000		3 360 000			
3.125	PRINCIPAL FINANCIAL GLOBAL FUNDING 3.125%/06-29.06	120 000		120 000			
0.5	QNB FINANCE LTD 0.5%/13-27.06.2016	410 000		410 000			
						6 975 970.00	0.52
Chile							
1.375	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1.375%/14-09.05.20	500 000			500 000	501 000.00	0.04
0.25	BANCO DE CHILE 0.25%/15-17.06.2020		1 000 000	1 000 000			
1.25	BANCO DE CHILE 1.25%/14-21.03.2019	600 000			600 000	615 900.00	0.05
0.875	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 0.875%/14-23.11.2	700 000			700 000	713 650.00	0.05
1.125	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 1.125%/14-26.06.2	600 000			600 000	615 600.00	0.05
1.25	BANCO DE CREDITO E INVERERSIONES 1.25%/13-26.09.20	2 550 000			2 550 000	2 579 070.00	0.19
1	BANCO SANTANDER CHILE 1%/14-31.07.2017	2 500 000			2 500 000	2 537 500.00	0.19
1.75	BANCO SANTANDER CHILE 1.75%/13-26.09.2019	250 000			250 000	263 375.00	0.02
1.125	CHILE 1.125%/13-23.05.2018	2 655 000	1 940 000		4 595 000	4 700 685.00	0.35
1.125	CHILE 1.125%/13-25.07.2017	1 650 000			1 650 000	1 681 350.00	0.13
2.875	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO 2.875%/13-05.12.2018	1 000 000			1 000 000	1 047 500.00	0.08
						15 255 630.00	1.14
Curacao							
1.5	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.5%/12-25.10.2018	2 700 000	700 000		3 400 000	3 517 300.00	0.26
						3 517 300.00	0.26
Deutschland							
4	BAYERISCHE LB (subordinated) 4%/01-21.09.2015	615 000		615 000			
3.125	BAYERISCHE LB 3.125%/07-27.06.2018	1 270 000			1 270 000	1 396 365.00	0.10
2.75	BERLIN 2.75%/07-03.05.2017	1 445 000			1 445 000	1 526 642.50	0.11
3	DEPFA 3%/03-15.09.2015	500 000		500 000			
2.375	DEUTSCHE HYPOTHEKENBANK 2.375%/05-09.12.2015	300 000		300 000			
2.5	DEUTSCHE HYPOTHEKENBANK 2.5%/06-08.03.2018	1 730 000			1 730 000	1 845 045.00	0.14
2.125	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK 2.125%/09-02.11.2016	1 040 000			1 040 000	1 063 192.00	0.08
2.5	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK 2.5%/05-09.03.2017	1 760 000			1 760 000	1 819 840.00	0.14
2.25	DEUTSCHE TELEKOM 2.25%/10-08.07.2016	2 260 000		2 260 000			
2	DZ BANK AG 2%/12-14.11.2017	390 000			390 000	403 650.00	0.03
3	HSB NORDBANK 3%/07-14.06.2019	1 950 000			1 950 000	2 191 800.00	0.16
3.375	HYPOTHEKENBANK FRANKFURT 3.375%/07-07.01.2016	250 000		250 000			
2.125	KFW 2.125%/06-15.02.2016	1 250 000		1 250 000			
2.75	KFW 2.75%/09-11.10.2018	1 700 000			1 700 000	1 885 300.00	0.14
3.375	KFW 3.375%/07-30.08.2017	3 085 000			3 085 000	3 336 427.50	0.25
2	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 2%/10-01.10.20	900 000			900 000	996 750.00	0.07
3.5	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG (subordinated) 3.5%/	760 000		760 000			
2.875	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.875%/04-30.12.2015	570 000		570 000			
3	LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN 3%/04-29.12.2015	500 000		500 000			
2.125	LANDESKREDITBANK BADEN-WUERTTEMBERG-FOERDERBANK 2.	450 000		450 000			
2.5	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.5%/11-05.03.2018	870 000			870 000	938 730.00	0.07
2.625	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.625%/09-07.07.2016	980 000		980 000			
1.75	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 1.75%/10-16.01.2017	2 050 000			2 050 000	2 115 190.00	0.16
2.125	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.125%/05-29.08.201	1 380 000			1 380 000	1 455 210.00	0.11
1.875	METRO 1.875%/12-02.05.2016	1 080 000		1 080 000			
3	MUENCHENER HYPOTHEKENBANK 3%/07-12.06.2017	1 250 000			1 250 000	1 322 500.00	0.10
2.25	NORDRHEIN-WESTFALEN 2.25%/06-01.03.2019	1 550 000			1 550 000	1 699 575.00	0.13

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
3.25	NORDRHEIN-WESTFALEN 3.25%/07-28.08.2015	330 000		330 000			
1.625	STATE OF HESSE 1.625%/10-29.09.2016	690 000			690 000	706 008.00	0.05
3.125	STATE OF HESSEN 3.125%/08-30.10.2015	600 000		600 000			
3.25	STATE OF HESSEN 3.25%/08-22.05.2017	895 000			895 000	954 965.00	0.07
						25 657 190.00	1.92
Dänemark							
1.5	DANSKE BANK 1.5%/12-21.12.2016	650 000			650 000	662 285.00	0.05
2.125	DANSKE BANK 2.125%/11-17.05.2018	750 000	500 000		1 250 000	1 338 750.00	0.10
2.25	DANSKE BANK 2.25%/10-12.09.2017		100 000		100 000	105 450.00	0.01
2.375	DANSKE BANK 2.375%/09-13.01.2017	2 090 000			2 090 000	2 168 166.00	0.16
2.25	KOMMUNEKREDIT 2.25%/10-16.08.2019	700 000			700 000	776 300.00	0.06
2.625	KOMMUNEKREDIT 2.625%/06-17.10.2016	2 730 000			2 730 000	2 827 461.00	0.21
3.25	KOMMUNEKREDIT 3.25%/08-08.05.2018	460 000			460 000	507 380.00	0.04
1.75	NYKREDIT BANK 1.75%/12-26.09.2016	630 000			630 000	641 088.00	0.05
						9 026 880.00	0.68
Finnland							
1.625	MUNICIPALITY FINANCE 1.625%/11-07.02.2018	825 000	3 100 000		3 925 000	4 140 875.00	0.31
1.75	MUNICIPALITY FINANCE 1.75%/10-26.05.2017	1 410 000			1 410 000	1 467 105.00	0.11
2.375	MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/09-11.03.2016	1 000 000		1 000 000			
						5 607 980.00	0.42
Frankreich							
2.5	AEROPORTS DE PARIS 2.5%/10-27.01.2017	1 450 000			1 450 000	1 506 550.00	0.11
3	ASSISTANCE PUBLIQUE DES HOPITAUX DE PARIS 3%/08-21	1 430 000			1 430 000	1 485 198.00	0.11
3.375	ASSISTANCE PUBLIQUE DES HOPITAUX DE PARIS 3.375%/0	50 000		50 000			
1.125	BFCM 1.125%/14-12.02.2019	1 050 000	1 470 000		2 520 000	2 610 720.00	0.20
1.125	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.125%/12-21.	1 500 000			1 500 000	1 546 500.00	0.12
1.625	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.625%/12-05.	1 350 000	3 780 000		5 130 000	5 489 100.00	0.41
1.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.25%/13-16.12.		4 000 000		4 000 000	4 306 000.00	0.32
3.25	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.25%/07-13.11.	300 000	200 000		500 000	541 250.00	0.04
3.625	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.625%/08-16.04	1 100 000			1 100 000	1 217 150.00	0.09
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-09.08.2017	1 940 000			1 940 000	2 087 440.00	0.16
3.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT 3.5%/07-28.08.2019	450 000			450 000	516 150.00	0.04
2.375	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.375%/06-09	1 410 000		1 410 000			
2.5	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.5%/09-02.0	2 570 000	500 000		3 070 000	3 309 460.00	0.25
2.625	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.625%/09-12	1 200 000			1 200 000	1 335 000.00	0.10
2	CFF 2%/10-20.12.2017	1 500 000			1 500 000	1 581 750.00	0.12
2.125	CFF 2.125%/11-11.05.2016	550 000		550 000			
2.25	CFF 2.25%/11-09.08.2019	700 000			700 000	768 600.00	0.06
2.375	CFF 2.375%/05-24.08.2018	5 220 000	1 000 000		6 220 000	6 720 710.00	0.50
2.75	CFF 2.75%/04-15.11.2016	1 260 000			1 260 000	1 308 636.00	0.10
2.875	CFF 2.875%/09-10.09.2019	1 250 000	1 100 000		2 350 000	2 647 275.00	0.20
3	CFF 3%/08-19.08.2016	2 975 000			2 975 000	3 076 150.00	0.23
2	CIF EUROMORTGAGE 2%/10-30.01.2019	950 000	1 400 000		2 350 000	2 519 200.00	0.19
2.375	CIF EUROMORTGAGE 2.375%/10-05.03.2019	750 000	1 500 000		2 250 000	2 448 000.00	0.18
1.375	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 1.375%/12-30.07.2018	2 090 000			2 090 000	2 191 365.00	0.16
1.75	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 1.75%/10-27.07.2017	1 420 000			1 420 000	1 481 060.00	0.11
1.5	CRH 1.5%/10-21.09.2015	600 000		600 000			
1.75	CRH 1.75%/11-29.03.2016	1 415 000		1 415 000			
4.125	DANONE FINANCE 4.125%/08-20.06.2016	760 000		760 000			
2.25	EDF 2.25%/10-29.09.2017	1 510 000	250 000		1 760 000	1 840 960.00	0.14
4	EDF 4%/09-27.03.2017	1 455 000			1 455 000	1 542 300.00	0.12
1.125	GDF SUEZ 1.125%/12-09.10.2020		200 000		200 000	209 700.00	0.02
1.5	GDF SUEZ 1.5%/11-20.10.2017	1 190 000			1 190 000	1 226 890.00	0.09
1.75	HSBC SFH FRANCE 1.75%/10-07.09.2015	480 000		480 000			
2	HSBC SFH FRANCE 2%/10-23.04.2019	300 000	1 875 000		2 175 000	2 354 437.50	0.18
2.375	HSBC SFH FRANCE 2.375%/10-07.09.2018	300 000			300 000	324 600.00	0.02
1.625	ILE DE FRANCE 1.625%/10-08.12.2017	550 000			550 000	575 575.00	0.04
2.375	ILE DE FRANCE 2.375%/05-28.12.2016	1 120 000			1 120 000	1 162 000.00	0.09
3.25	ILE DE FRANCE 3.25%/07-27.11.2018	1 650 000	250 000		1 900 000	2 124 200.00	0.16
2.5	MFINANCE FRANCE 2.5%/13-08.10.2018	1 800 000	1 700 000		3 500 000	3 577 000.00	0.27
1.625	ORANGE 1.625%/11-13.10.2016	2 130 000			2 130 000	2 172 600.00	0.16
3.25	PARIS 3.25%/08-05.11.2018	300 000			300 000	334 200.00	0.03
2.625	RATP 2.625%/06-06.11.2019	2 000 000			2 000 000	2 224 000.00	0.17
1.5	RCI BANQUE 1.50%/13-19.07.2016	950 000			950 000	962 255.00	0.07
3.375	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARIS 3.375%/08-21.0	585 000		585 000			
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/07-0	1 170 000			1 170 000	1 260 675.00	0.09
3.25	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25%/08-0	670 000			670 000	723 600.00	0.05
3.375	SANOFI 3.375%/07-21.12.2015	1 110 000		1 110 000			
3	SNCF RESEAU 3%/09-24.04.2019	2 100 000	1 000 000		3 100 000	3 476 650.00	0.26
5	SNCF 5%/95-20.10.2015	520 000		520 000			
2.375	SNCF MOBILITES 2.375%/09-24.07.2019	1 400 000			1 400 000	1 537 900.00	0.12
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-11.06.2018	1 160 000	1 370 000		2 530 000	2 738 725.00	0.21
2.75	SNCF MOBILITES 2.75%/09-23.01.2019	1 250 000			1 250 000	1 376 250.00	0.10
0.875	SOCIETE GENERALE 0.875%/13-19.06.2018	590 000			590 000	603 275.00	0.05
1.875	SOCIETE GENERALE 1.875%/10-19.10.2015	840 000		840 000			
3.125	TOTAL CAPITAL 3.125%/06-28.06.2018	2 405 000	1 300 000		3 705 000	4 049 565.00	0.30
2.125	VINCI 2.125%/11-15.12.2017	1 050 000			1 050 000	1 099 350.00	0.08
						88 189 971.50	6.61
Guernsey							
0.625	CREDIT SUISSE GROUP FUNDING (GUERNSEY) 0.625%/15-2		1 000 000		1 000 000	997 000.00	0.07
						997 000.00	0.07
Honduras							
0.5	CABEI T. -A- 0.5%/14-26.11.2018	1 000 000	2 575 000		3 575 000	3 635 775.00	0.27
0.625	CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.	1 000 000			1 000 000	1 009 600.00	0.08
1.5	CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 1.5	500 000	1 400 000		1 900 000	2 016 850.00	0.15
						6 662 225.00	0.50
Hongkong							
0.875	BK OF COMMUNICATIONS - HONG KONG BRANCH 0.875%/14-	1 500 000			1 500 000	1 511 250.00	0.11
1.375	CHINA CONSTRUCTION BANK 1.375%/14-28.05.2019	1 300 000			1 300 000	1 319 500.00	0.10
						2 830 750.00	0.21

Titelbezeichnung	28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Indien						
3 BHARAT PETROLEUM 3%/14-20.12.2019	800 000	3 400 000		4 200 000	4 525 500.00	0.34
3.5 EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.5%/11-13.04.2016	400 000		400 000			
3.5 RURAL ELECTRIFICATION 3.5%/12-07.03.2017	1 400 000			1 400 000	1 439 900.00	0.11
					5 965 400.00	0.45
Internationale Organisationen						
2.625 AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.625%/09-25.03.2019	2 050 000			2 050 000	2 276 525.00	0.17
1.625 BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK 1.625%/15-20.		2 200 000		2 200 000	2 206 600.00	0.17
2.5 BLACK SEA TRADE AND DEVELOPMENT BANK 2.5%/12-04.10	800 000			800 000	805 680.00	0.06
1.5 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.5%/12-11.09.2018	1 700 000	160 000		1 860 000	1 952 070.00	0.15
3.375 COUNCIL OF EUROPE 3.375%/08-06.11.2020		850 000		850 000	1 017 025.00	0.08
1.25 EIB 1.25%/12-02.08.2019	1 900 000			1 900 000	2 034 900.00	0.15
1.75 EIB 1.75%/10-21.04.2017	2 360 000	750 000		3 110 000	3 229 735.00	0.24
2 EIB 2%/05-29.08.2016	1 580 000			1 580 000	1 620 606.00	0.12
2.125 EIB 2.125%/10-22.01.2020	1 500 000			1 500 000	1 677 000.00	0.13
2.375 EIB 2.375%/05-10.07.2020	3 000 000	5 000 000		8 000 000	9 112 000.00	0.68
2.5 EIB 2.5%/07-08.02.2019	5 970 000	2 000 000	600 000	7 370 000	8 165 960.00	0.61
3.25 EIB 3.25%/08-30.04.2018	660 000			660 000	729 960.00	0.05
2.125 IADB 2.125%/09-22.02.2016	550 000		550 000			
2.75 IADB 2.75%/09-15.04.2019	2 050 000			2 050 000	2 302 150.00	0.17
2.5 NORDIC INVESTMENT BANK 2.5%/09-11.04.2018	965 000			965 000	1 045 577.50	0.08
					38 175 788.50	2.86
Irland						
2.125 DEPFA ACS BANK 2.125%/05-13.10.2017	1 260 000			1 260 000	1 304 730.00	0.10
2.375 DEPFA ACS BANK 2.375%/06-15.02.2019	1 500 000			1 500 000	1 597 500.00	0.12
3.375 UNICREDIT BANK IRELAND 3.375%/12-25.10.2017	970 000			970 000	1 035 960.00	0.08
					3 938 190.00	0.30
Italien						
2.5 ITALY 2.5%/06-30.01.2018	6 540 000			6 540 000	6 919 320.00	0.52
					6 919 320.00	0.52
Jersey						
3 ASIF III 3%/04-29.12.2015	250 000		250 000			
2.5 HEATHROW FUNDING C. A 2.5%/12-08.02.2017	2 055 000			2 055 000	2 127 952.50	0.16
2.75 UBS JERSEY BRANCH (subordinated) 2.75%/06-28.04.20	730 000	250 000	980 000			
					2 127 952.50	0.16
Kanada						
2.875 BRITISH COLUMBIA 2.875%/09-27.12.2017	1 980 000	500 000		2 480 000	2 678 400.00	0.20
1 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 1%/12-13.02.201	1 300 000	2 000 000		3 300 000	3 453 450.00	0.26
1.75 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE LONDON 1.75%/10	2 390 000			2 390 000	2 485 600.00	0.19
2.625 EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.625%/09-24.07.2017	2 050 000			2 050 000	2 180 175.00	0.16
2.875 PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 2.875%/09-04.03.2016	1 130 000		1 130 000			
2.375 PROVINCE OF ONTARIO 2.375%/10-07.05.2020	2 000 000			2 000 000	2 260 000.00	0.17
2.5 PROVINCE OF ONTARIO 2.5%/09-04.12.2019	1 300 000			1 300 000	1 463 800.00	0.11
3.375 PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-01.12.2015	420 000		420 000			
3.375 PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/08-27.05.2016	1 180 000		1 180 000			
3.375 PROVINCE OF ONTARIO 3.375%/09-29.04.2019	800 000			800 000	913 200.00	0.07
3.75 PROVINCE OF ONTARIO 3.75%/08-30.07.2018	800 000			800 000	900 800.00	0.07
2.625 QUEBEC 2.625%/06-21.06.2017	3 105 000			3 105 000	3 283 537.50	0.25
3.375 QUEBEC 3.375%/08-19.01.2018	1 045 000			1 045 000	1 142 707.50	0.09
3.875 QUEBEC 3.875%/09-11.12.2018	550 000	250 000		800 000	914 400.00	0.07
0.625 ROYAL BANK OF CANADA 0.625%/14-09.04.2019	1 300 000			1 300 000	1 330 550.00	0.10
0.75 ROYAL BK CANADA TORONTO BRANCH 0.75%/13-23.10.2018	2 000 000	4 950 000		6 950 000	7 116 800.00	0.53
2.125 SASKATCHEWAN 2.125%/05-15.01.2016	1 050 000		1 050 000			
					30 123 420.00	2.26
Kasachstan						
2.59 NATIONAL COMPANY KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY 2.59%/14-2	1 000 000			1 000 000	966 500.00	0.07
					966 500.00	0.07
Liechtenstein						
0.875 HILTI 0.875%/13-30.10.2018	1 090 000			1 090 000	1 115 615.00	0.08
2 LGT BANK IN LIECHTENSTEIN 2%/12-02.07.2019	1 200 000	1 390 000		2 590 000	2 785 545.00	0.21
2.5 VP BANK 2.5%/10-27.05.2016	890 000		890 000			
					3 901 160.00	0.29
Litauen						
2 LITHUANIA 2%/12-11.04.2018	2 160 000			2 160 000	2 273 400.00	0.17
					2 273 400.00	0.17
Luxemburg						
0.313 BAVARIAN SKY -A- 0.313%/13-15.05.2016	1 270 000		1 270 000			
3 DEPFA PFANDBRIEF BANK INTERNATIONAL 3%/06-16.06.20	2 090 000		2 090 000			
2.125 GLENCORE FINANCE 2.125%/13-23.12.2019	1 000 000			1 000 000	1 025 000.00	0.08
2.625 GLENCORE FINANCE 2.625%/12-03.12.2018	3 000 000	1 000 000		4 000 000	4 180 000.00	0.31
3.625 GLENCORE FINANCE 3.625%/10-06.04.2016	4 140 000		4 140 000			
3.125 NORD/LB COVERED FINANCE BANK 3.125%/07-17.12.2015	240 000		240 000			
2.065 SB CAPITAL 2.065%/13-28.02.2017	3 950 000		3 950 000			
3.15 VTB CAPITAL 3.15%/12-16.12.2016	2 650 000		2 650 000			
					5 205 000.00	0.39
Mexiko						
1.125 AMERICA MOVIL 1.125%/12-12.09.2018	2 400 000	960 000		3 360 000	3 452 400.00	0.26
2 AMERICA MOVIL 2%/11-27.12.2017	1 285 000	140 000		1 425 000	1 489 837.50	0.11
0.75 MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO SAPI DE CV 0.75%/14	1 000 000			1 000 000	1 008 000.00	0.08
2.5 PETROLEOS MEXICANOS 2.5%/12-10.04.2019	1 900 000			1 900 000	2 014 000.00	0.15
					7 964 237.50	0.60
Neuseeland						
1.5 BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.5%/12-22.01.2018	1 220 000	2 000 000		3 220 000	3 337 530.00	0.25
0.875 KIWIBANK 0.875%/14-04.04.2019	1 000 000	3 350 000		4 350 000	4 476 150.00	0.34
					7 813 680.00	0.59
Niederlande						
1 ABN AMRO BANK 1%/12-19.04.2017	1 810 000	600 000		2 410 000	2 460 610.00	0.18
1.125 ABN AMRO BANK 1.125%/13-25.10.2018	1 340 000	1 910 000		3 250 000	3 352 375.00	0.25
1.125 ABN AMRO BANK 1.125%/14-24.04.2020		350 000		350 000	365 925.00	0.03
1.125 ABN AMRO BANK 1.125%/14-31.01.2019	700 000	500 000		1 200 000	1 240 800.00	0.09
1.625 ABN AMRO BANK 1.625%/10-28.10.2016	2 550 000			2 550 000	2 611 200.00	0.20
2.25 ABN AMRO BANK 2.25%/11-10.07.2018	250 000	1 300 000		1 550 000	1 661 600.00	0.12

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.375	ABN AMRO BANK 2.375%/11-02.02.2016	830 000		830 000			
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/06-30.12.2015	1 000 000		1 000 000			
2.5	ABN AMRO BANK 2.5%/12-16.02.2017	650 000			650 000	672 750.00	0.05
1.5	ACHMEA 1.5%/13-19.06.2019	1 100 000	500 000		1 600 000	1 674 400.00	0.13
3.5	ACHMEA BANK 3.5%/07-22.08.2017	700 000			700 000	748 650.00	0.06
3	BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL NETHERLANDS 3%/14-31.0		1 000 000		1 000 000	1 070 000.00	0.08
1.75	BMW FINANCE 1.75%/11-29.09.2017	1 670 000			1 670 000	1 732 625.00	0.13
1.5	BNG 1.5%/10-03.11.2017	1 700 000			1 700 000	1 779 900.00	0.13
1.75	BNG 1.75%/10-27.10.2020				250 000	277 625.00	0.02
2.125	BNG 2.125%/10-06.11.2018	1 600 000	2 000 000		3 600 000	3 906 000.00	0.29
2.25	BNG 2.25%/05-14.10.2020		250 000		250 000	284 625.00	0.02
2.375	BNG 2.375%/10-19.11.2019	2 000 000			2 000 000	2 242 000.00	0.17
2.5	BNG 2.5%/09-14.10.2019	1 850 000			1 850 000	2 079 400.00	0.16
2.625	BNG 2.625%/07-09.02.2017	1 550 000			1 550 000	1 622 075.00	0.12
2.75	BNG 2.75%/09-11.05.2016	1 990 000		1 990 000			
3.125	BNG 3.125%/07-02.07.2018	1 925 000	5 800 000		7 725 000	8 567 025.00	0.64
1.625	DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE 1.625%/11-12.10.2016	450 000			450 000	458 325.00	0.03
0.75	DEUTSCHE BAHN FINANCE 0.75%/12-21.08.2017	2 360 000			2 360 000	2 410 740.00	0.18
1.5	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/11-18.12.2017	1 400 000			1 400 000	1 461 600.00	0.11
1.75	DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.75%/10-03.06.2020		500 000		500 000	546 250.00	0.04
0.625	EBN 0.625%/12-04.07.2019	1 100 000	2 650 000		3 750 000	3 866 250.00	0.29
0.75	EBN 0.75%/11-03.10.2016	1 810 000			1 810 000	1 831 720.00	0.14
1.25	ENBW INTERNATIONAL FINANCE 1.25%/13-12.07.2018	310 000	2 730 000		3 040 000	3 138 800.00	0.24
2	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 2%/11-23.12.2015	640 000		640 000			
2.75	ENEL FINANCE INTERNATIONAL 2.75%/12-17.12.2018	1 350 000	200 000		1 550 000	1 673 225.00	0.13
2.125	F.VAN LANSCHOT BANKIERS 2.125%/12-04.04.2016	1 115 000		1 115 000			
2.125	GAS NATURAL FINANCE 2.125%/13-08.02.2019	1 400 000	750 000		2 150 000	2 279 000.00	0.17
3	IBERDROLA INTERNATIONAL 3%/12-13.02.2017	1 300 000			1 300 000	1 355 900.00	0.10
0.5	ING BANK 0.5%/13-13.09.2016	1 000 000			1 000 000	1 004 400.00	0.08
1	ING BANK 1%/13-14.09.2018	2 100 000			2 100 000	2 161 950.00	0.16
1.875	ING BANK 1.875%/10-29.08.2018	1 195 000			1 195 000	1 273 870.00	0.10
2.125	ING BANK 2.125%/10-07.10.2016	1 950 000			1 950 000	1 994 070.00	0.15
2.25	LEASEPLAN 2.25%/12-18.07.2016	630 000			630 000	642 033.00	0.05
2.625	NEDERLANDEN FINANCIERINGS MAAT 2.625%/08-22.09.201	290 000		290 000			
2.875	NEDERLANDSE FINANCIERINGS-MAATSCHAPPIJ VOOR ONTWIK	1 400 000		1 400 000			
1	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1%/12-01.02.2018	495 000	2 500 000		2 995 000	3 113 302.50	0.23
1.75	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.75%/10-22.07.2016	1 910 000		1 500 000	410 000	418 405.00	0.03
1.875	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 1.875%/10-03.02.2020		300 000		300 000	332 400.00	0.02
2	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2%/10-10.10.2017	1 065 000			1 065 000	1 123 042.50	0.08
2.25	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.25%/10-03.09.2019	1 400 000			1 400 000	1 555 400.00	0.12
2.5	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 2.5%/06-27.12.2018	1 100 000			1 100 000	1 212 750.00	0.09
3	NIBC BANK 3%/13-19.12.2016	1 135 000			1 135 000	1 170 752.50	0.09
1.125	PACCAR FINANCIAL EUROPE 1.125%/12-06.03.2017	450 000			450 000	456 525.00	0.03
1.25	RABOBANK 1.25%/12-15.10.2020	1 000 000	5 750 000		6 750 000	7 128 000.00	0.53
2	RABOBANK 2%/11-31.01.2018	920 000			920 000	966 000.00	0.07
2	RABOBANK 2%/12-06.02.2019	1 800 000		650 000	1 150 000	1 228 775.00	0.09
2.125	RABOBANK 2.125%/05-11.10.2017	4 330 000			4 330 000	4 535 675.00	0.34
3	RABOBANK 3%/09-10.06.2016	1 020 000	350 000	1 370 000			
3.625	RABOBANK 3.625%/09-02.07.2019	2 150 000			2 150 000	2 445 625.00	0.18
3.875	WUERTH FINANCE INTERNATIONAL 3.875%/09-03.08.2015	535 000		535 000			
						90 134 370.50	6.76
Norwegen							
1.75	DNB BANK ASA 1.75%/12-18.04.2018	560 000			560 000	585 760.00	0.04
2.125	DNB BANK ASA 2.125%/10-12.11.2015	580 000		580 000			
1.5	DNB BOLIGKREDIT 1.5%/11-24.02.2017	650 000			650 000	668 850.00	0.05
1.875	DNB BOLIGKREDIT 1.875%/11-02.02.2016	960 000		960 000			
2.25	DNB BOLIGKREDIT 2.25%/10-26.03.2018	1 030 000			1 030 000	1 100 555.00	0.08
3.375	DNB BOLIGKREDIT 3.375%/07-16.11.2016	1 025 000			1 025 000	1 073 175.00	0.08
3.375	DNB BOLIGKREDIT 3.375%/08-13.07.2016	670 000		670 000			
2.875	KOMMUNALBANKEN 2.875%/09-09.05.2017	970 000			970 000	1 026 260.00	0.08
1.375	NORWEGIAN RAILWAYS 1.375%/10-15.11.2017	1 080 000	2 750 000		3 830 000	3 983 200.00	0.30
2.125	NORWEGIAN RAILWAYS 2.125%/11-14.02.2020		250 000		250 000	273 375.00	0.02
0.875	SPAREBANK 1 SR BANK 0.875%/13-30.11.2018	2 310 000	1 500 000		3 810 000	3 903 345.00	0.29
2.625	STATNETT 2.625%/06-15.12.2017	800 000	745 000		1 545 000	1 639 245.00	0.12
						14 253 765.00	1.07
Oesterreich							
2.5	AUSTRIA 2.5%/09-14.07.2016	3 760 000		3 500 000	260 000	266 786.00	0.02
1.25	BAWAG P.S.K. 1.25%/10-30.09.2015	570 000		570 000			
4.5	BAWAG PSK 4.5%/00-16.10.2015	550 000		550 000			
2.125	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 2.125%/05-12.	250 000	1 250 000		1 500 000	1 610 250.00	0.12
3.25	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/07-16.0	1 050 000			1 050 000	1 186 500.00	0.09
3.25	BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.25%/08-02.1	500 000	350 000		850 000	915 875.00	0.07
3.25	ERSTE GROUP BANK 3.25%/07-10.07.2017	940 000			940 000	984 180.00	0.07
2.5	HETA ASSET RESOLUTION 2.5%/05-13.06.2016	2 260 000		2 260 000			
2.25	HYPO INVESTMENTBANK 2.25%/05-02.08.2017	2 230 000			2 230 000	2 296 900.00	0.17
2.875	HYPO NOE GRUPPE BANK 2.875%/07-22.02.2016	1 600 000		1 600 000			
2.375	HYPO TIROL BANK 2.375%/05-21.03.2017	2 935 000		2 935 000			
2.375	HYPO TIROL BANK 2.375%/06-13.09.2017	710 000		710 000			
2.375	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 2.375%/05-15.03.2017	1 630 000			1 630 000	1 638 150.00	0.12
2.125	LAND NIEDEROESTERREICH 2.125%/10-15.08.2017	2 130 000			2 130 000	2 230 110.00	0.17
2.625	NIEDEROESTERREICHISCHE LHB 2.625%/06-07.02.2017	2 235 000			2 235 000	2 304 285.00	0.17
2.5	OBEROESTERREICHISCHE LB 2.5%/06-20.06.2017	900 000			900 000	927 000.00	0.07
2.75	OBEROESTERREICHISCHE LB 2.75%/07-19.08.2016	1 940 000			1 940 000	1 983 650.00	0.15
1.125	OEKB 1.125%/12-24.05.2018	2 005 000	1 000 000		3 005 000	3 138 722.50	0.24
1.75	OEKB 1.75%/11-14.06.2017	715 000			715 000	743 600.00	0.06
2.125	OEKB 2.125%/05-18.10.2018	1 600 000	1 365 000		2 965 000	3 206 647.50	0.24
2.125	OEKB 2.125%/11-23.07.2019	1 400 000	1 100 000		2 500 000	2 750 000.00	0.21
2.75	OEKB 2.75%/05-28.01.2020	2 400 000			2 400 000	2 742 000.00	0.21
3	OEKB 3%/08-06.10.2016	800 000			800 000	830 240.00	0.06
1.125	OEKBOESTERREICHISCHE KONTROLLBANK 1.125%/13-24.07.	1 500 000			1 500 000	1 611 000.00	0.12
1.5	OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK 1.5%/11-23.02.2016	500 000		500 000			
2.125	PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.125%/	2 985 000		2 985 000			

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.5	PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.5%/05	680 000		680 000			
2.875	PFANDBRIEFSTELLE DER OESTERREICHISCHEN LHB 2.875%/	6 490 000		6 490 000			
1	RAIFFEISENLANDESBANK OBEROESTERREICH 1%/12-07.11.2	630 000			630 000	620 928.00	0.05
1.375	VORARLBERGER LANDES UND HYPOTHEKENBANK 1.375%/13-2	1 270 000			1 270 000	1 258 570.00	0.09
2.375	VORARLBERGER LHB 2.375%/06-09.08.2017	3 145 000			3 145 000	3 251 930.00	0.24
2.5	VORARLBERGER LHB 2.5%/05-15.02.2016	1 750 000		1 750 000			
2.625	VORARLBERGER LHB 2.625%/06-09.11.2015	500 000		500 000			
						36 497 324.00	2.74
Panama							
1.625	BANCO GENERAL 1.625%/14-18.06.2018	2 200 000			2 200 000	2 222 000.00	0.17
						2 222 000.00	0.17
Peru							
1.25	FONDO MIVIVIENDA 1.25%/14-13.06.2018	1 200 000			1 200 000	1 225 200.00	0.09
						1 225 200.00	0.09
Polen							
	POLAND 0%/15-08.05.2018		3 500 000		3 500 000	3 507 000.00	0.26
2.25	POLAND 2.25%/12-15.05.2018	1 200 000			1 200 000	1 278 000.00	0.10
2.75	POLAND 2.75%/11-25.02.2016	1 600 000		1 600 000			
3.25	POLAND 3.25%/07-15.05.2019	4 800 000			4 800 000	5 385 600.00	0.40
3.625	POLAND 3.625%/08-21.04.2017	2 035 000			2 035 000	2 162 187.50	0.16
						12 332 787.50	0.92
Schweden							
1.5	AKADEMISKA HUS 1.5%/11-20.04.2016	520 000		520 000			
2.125	AKADEMISKA HUS 2.125%/10-04.07.2018	290 000	1 400 000		1 690 000	1 817 595.00	0.14
2.625	KOMMUNINVEST I SVERIGE 2.625%/07-07.12.2016	800 000			800 000	832 160.00	0.06
1.5	LANDSHYPOTEK 1.5%/10-13.12.2016	1 250 000			1 250 000	1 280 000.00	0.10
1.5	LANDSHYPOTEK 1.5%/11-24.10.2018	770 000	2 500 000		3 270 000	3 462 930.00	0.26
1	LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 1%/12-29.05.2019	600 000	1 000 000		1 600 000	1 666 400.00	0.12
1.75	LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 1.75%/10-21.07.2015	60 000		60 000			
0.75	NORDEA BANK 0.75%/14-04.10.2019	1 500 000			1 500 000	1 545 000.00	0.12
0.875	NORDEA BANK 0.875%/13-25.09.2018	2 650 000	1 175 000		3 825 000	3 930 187.50	0.29
1.125	NORDEA BANK 1.125%/12-02.10.2020		245 000		245 000	258 230.00	0.02
1.5	NORDEA BANK 1.5%/12-29.09.2017	1 815 000	100 000		1 915 000	1 977 237.50	0.15
2.25	NORDEA BANK AB 2.25%/10-06.05.2016	1 665 000		1 665 000			
1.875	NORDEA HYPOTEK 1.875%/10-07.06.2016	700 000		700 000			
3.538	PKO FINANCE 3.538%/11-07.07.2016	1 100 000		1 100 000			
2	SBAB BANK 2%/11-06.12.2018	2 120 000	500 000		2 620 000	2 777 200.00	0.21
2	SBAB BANK AB 2.0%/11-17.02.2016	680 000		680 000			
2.125	SCBC 2.125%/10-15.02.2017	665 000	1 400 000		2 065 000	2 143 470.00	0.16
2	STADSHYPOTEK 2%/10-01.12.2016	1 050 000			1 050 000	1 083 600.00	0.08
0.625	SVENSKA HANDELSBANKEN 0.625%/14-11.12.2018	800 000	2 410 000		3 210 000	3 285 435.00	0.25
1.25	SVENSKA HANDELSBANKEN 1.25%/13-20.12.2019	2 100 000			2 100 000	2 212 350.00	0.17
1.625	SWEDBANK MORTGAGE 1.625%/10-08.12.2017	540 000			540 000	565 110.00	0.04
2.125	SWEDBANK MORTGAGE 2.125%/10-26.08.2016	1 305 000			1 305 000	1 339 713.00	0.10
2.125	SWEDISH COVERED BOND CORPORATION 2.125%/09-08.06.2	1 340 000		1 340 000			
1.875	SWEDISH EXPORT CREDIT 1.875%/10-08.03.2017	1 180 000			1 180 000	1 224 250.00	0.09
2.625	SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/07-09.02.2017	2 575 000			2 575 000	2 694 737.50	0.20
2.625	SWEDISH EXPORT CREDIT 2.625%/09-28.12.2015	570 000		570 000			
3	SWEDISH EXPORT CREDIT 3%/09-27.02.2018	1 855 000			1 855 000	2 019 167.50	0.15
						36 114 773.00	2.71
Schweiz							
1.125	AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.125%/11-15.11.2018	1 500 000	2 920 000		4 420 000	4 612 270.00	0.35
2	AARGAUISCHE KANTONALBANK 2%/09-09.09.2016	980 000			980 000	1 003 618.00	0.08
3.5	AARGAUISCHE KANTONALBANK 3.5%/08-14.08.2017	990 000			990 000	1 062 765.00	0.08
1.25	ABB 1.25%/11-11.10.2016	2 790 000			2 790 000	2 830 734.00	0.21
1.5	ABB 1.5%/12-23.11.2018	1 000 000	5 000 000		6 000 000	6 288 000.00	0.47
1.875	ADECCO 1.875%/12-18.12.2017	1 450 000	250 000		1 700 000	1 764 600.00	0.13
2.125	ADECCO 2.125%/12-08.02.2016	1 700 000		1 700 000			
2.625	ADECCO 2.625%/12-18.12.2020		750 000		750 000	844 875.00	0.06
2.25	ADUNO HOLDING 2.25%/11-27.10.2017	1 260 000			1 260 000	1 320 480.00	0.10
1.25	ALLREAL HOLDING 1.25%/14-02.04.2019	500 000			500 000	516 750.00	0.04
2.5	ALLREAL HOLDING 2.5%/11-12.05.2016	660 000		660 000			
2	ALLREAL HOLDING LTD 2%/13-23.09.2020		1 700 000		1 700 000	1 828 350.00	0.14
2	ALPIQ HOLDING 2%/12-13.04.2017	1 600 000		770 000	830 000	843 280.00	0.06
2.625	ALPIQ HOLDING 2.625%/06-01.03.2018	1 490 000		1 215 000	275 000	284 625.00	0.02
3	ALPIQ HOLDING 3%/09-25.11.2019	2 500 000	1 930 000		940 000	3 690 675.00	0.28
3.875	ALPIQ HOLDING 3.875%/08-30.10.2018	2 120 000		1 155 000	965 000	1 044 612.50	0.08
4	ALPIQ HOLDING 4%/09-10.02.2017	400 000		225 000	175 000	182 437.50	0.01
2.625	AXPO HOLDING 2.625%/10-26.02.2020	3 500 000			3 500 000	3 850 000.00	0.29
1	BALOISE-HOLDING 1%/12-12.10.2017	850 000			850 000	867 850.00	0.07
2.25	BALOISE-HOLDING 2.25%/12-01.03.2019	400 000			400 000	430 000.00	0.03
2	BANK SARASIN 2%/10-15.10.2015	655 000		655 000			
3.125	BANQUE CANTONALE DE GENEVE 3.125%/11-07.11.2018	1 000 000			1 000 000	1 083 000.00	0.08
2.5	BANQUE CANTONALE VAUDOISE 2.5%/10-25.03.2020		300 000		300 000	336 900.00	0.03
0.625	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.625%/12-27.02.	2 325 000	2 550 000		4 875 000	4 982 250.00	0.37
1.75	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75%/10-25.06.2	1 400 000	1 985 000		3 385 000	3 628 720.00	0.27
3	BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 3%/07-14.12.2017	1 080 000			1 080 000	1 162 080.00	0.09
1.5	BASLER KANTONALBANK 1.5%/10-26.10.2018	2 550 000	2 470 000		5 020 000	5 296 100.00	0.40
2.75	BASLER KANTONALBANK 2.75%/04-22.12.2016	1 100 000			1 100 000	1 144 330.00	0.09
1	BELL 1%/13-16.05.2018	1 050 000			1 050 000	1 075 725.00	0.08
2.875	BERNER KANTONALBANK 2.875%/04-22.04.2016	450 000		450 000			
1.875	BKW 1.875%/10-15.10.2018	600 000	1 150 000		1 750 000	1 841 875.00	0.14
3.375	BKW 3.375%/09-29.07.2019	1 500 000			1 500 000	1 685 250.00	0.13
0.125	CANTON OF ZURICH 0.125%/13-29.07.2015	860 000		860 000			
0.75	CEMBRA MONEY BANK 0.75%/14-14.10.2019	500 000			500 000	509 500.00	0.04
1.125	CEMBRA MONEY BANK 1.125%/13-29.11.2017	2 175 000	500 000		2 675 000	2 736 525.00	0.21
1	CLIENTIS 1%/13-18.04.2018	175 000			175 000	178 062.50	0.01
1.25	COOP GENOSSENSCHAFT 1.25%/12-25.07.2019	1 150 000			1 150 000	1 194 275.00	0.09
2	COOP GENOSSENSCHAFT 2%/10-29.09.2017	570 000			570 000	593 370.00	0.04
2	COOP GENOSSENSCHAFT 2%/10-30.06.2016	2 280 000		2 280 000			
3.25	COOP GENOSSENSCHAFT 3.25%/09-31.07.2015	1 420 000		1 420 000			

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
0.25	COOP-GRUPPE 0.25%/15-31.07.2020		1 000 000		1 000 000	1 000 000.00	0.07
0.75	CREDIT SUISSE 0.75%/14-11.07.2019	2 000 000	1 000 000		3 000 000	3 073 500.00	0.23
2.375	CREDIT SUISSE 2.375%/10-21.06.2017	2 000 000			2 000 000	2 080 000.00	0.16
3.375	CREDIT SUISSE 3.375%/10-16.03.2020		500 000		500 000	561 250.00	0.04
2.5	EGL 2.5%/05-23.11.2015	980 000		980 000			
2.25	ELECTRICITE D'EMOSSON 2.25%/05-26.10.2017	420 000			420 000	434 700.00	0.03
1	ELSEVIER FINANCE 1%/13-18.12.2018	725 000	250 000		975 000	994 987.50	0.07
2.25	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 25 2.25%/05-19.09.2017	740 000			740 000	781 440.00	0.06
2.375	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 27 2.375%/06-12.01.2018	425 000			425 000	453 475.00	0.03
3.125	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 32 3.125%/07-12.12.2016	320 000			320 000	334 848.00	0.03
3.5	EMISSIONSZENTRALE EGW S. 33 3.5%/08-18.05.2018	870 000	1 000 000		1 870 000	2 070 090.00	0.16
2.125	EMMI FINANZ 2.125%/11-30.06.2017	1 060 000			1 060 000	1 100 280.00	0.08
2.75	ENGADINER KRAFTWERKE 2.75%/06-10.10.2016	995 000			995 000	1 023 954.50	0.08
2.125	EUROFIMA BASEL 2.125%/09-10.11.2017	1 550 000			1 550 000	1 635 250.00	0.12
2.25	EUROFIMA BASEL 2.25%/05-15.06.2016	1 650 000		1 650 000			
2.375	EUROFIMA BASEL 2.375%/05-03.08.2020		500 000		500 000	561 750.00	0.04
3.25	EUROFIMA BASEL 3.25%/03-28.12.2018	2 100 000			2 100 000	2 347 800.00	0.18
3.375	EUROFIMA BASEL 3.375%/04-29.12.2020		400 000		400 000	473 800.00	0.04
2	FEDERATION OF MIGROS COOPERATIVES 2%/11-03.05.2017	650 000			650 000	675 350.00	0.05
1.5	FIDIS FINANCE 1.5%/14-25.07.2017	500 000			500 000	506 750.00	0.04
2.25	FLUGHAFEN ZUERICH 2.25%/11-05.05.2017	1 300 000			1 300 000	1 350 700.00	0.10
1.375	FREIBURGER KANTONALBANK 1.375%/11-23.02.2016	430 000		430 000			
1.875	FREIBURGER KANTONALBANK 1.875%/10-17.02.2017	1 055 000	600 000		1 655 000	1 706 305.00	0.13
2.5	GALENICA 2.5%/10-27.10.2017	1 145 000			1 145 000	1 197 097.50	0.09
0.05	GEBERIT 0.05%/15-17.04.2019		1 200 000		1 200 000	1 200 000.00	0.09
3.375	GEORG FISCHER 3.375%/10-12.05.2016	580 000		580 000			
1.5	GEORG FISCHER FINANZ 1.5%/13-12.09.2018	400 000			400 000	413 000.00	0.03
1.25	GIVAUDAN 1.25%/11-07.12.2016	1 075 000			1 075 000	1 091 232.50	0.08
2.5	GIVAUDAN 2.5%/11-15.06.2018	1 800 000	1 500 000		3 300 000	3 537 600.00	0.27
3.375	GRANDE DIXENCE 3.375%/07-27.09.2017	1 200 000			1 200 000	1 270 200.00	0.10
2	GRAUBUENDNER KANTONALBANK 2%/10-08.02.2017	1 450 000			1 450 000	1 497 850.00	0.11
0.75	GRAUBUNDER KANTONALBANK 0.75%/12-14.06.2019	600 000	500 000		1 100 000	1 138 500.00	0.09
1.125	HELVETIA HOLDING 1.125%/13-08.04.2019	900 000			900 000	933 300.00	0.07
2.375	HOLCIM 2.375%/10-07.06.2016	2 465 000		2 465 000			
3.125	HOLCIM 3.125%/07-20.02.2017	2 780 000			2 780 000	2 896 760.00	0.22
4	HOLCIM 4%/09-11.09.2018	1 550 000			1 550 000	1 725 150.00	0.13
3.125	IMPLENIA 3.125%/10-12.05.2016	610 000		610 000			
0.875	KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.875%/11-08.09.2016	1 250 000			1 250 000	1 268 500.00	0.10
0.125	KANTON BASEL-STADT 0.125%/12-29.08.2017	470 000			470 000	474 935.00	0.04
0.5	KANTON BASEL-STADT 0.5%/13-28.11.2018	2 750 000	2 450 000		5 200 000	5 343 000.00	0.40
1.875	KANTON BASEL-STADT 1.875%/10-31.05.2019	1 750 000	2 650 000		4 400 000	4 765 200.00	0.36
3.25	KANTON BASEL-STADT 3.25%/08-31.01.2020	2 000 000			2 000 000	2 311 000.00	0.17
2.625	KANTON BERN 2.625%/09-24.04.2020	500 000	900 000		1 400 000	1 586 200.00	0.12
3.125	KANTON BERN 3.125%/07-27.06.2019	1 400 000	1 300 000		2 700 000	3 059 100.00	0.23
0.25	KANTON GENF 0.25%/13-20.09.2016	1 500 000			1 500 000	1 511 400.00	0.11
0.5	KANTON GENF 0.5%/12-29.05.2017	2 340 000			2 340 000	2 373 930.00	0.18
2.5	KANTON GENF 2.5%/09-27.11.2019	1 000 000			1 000 000	1 117 500.00	0.08
3.125	KANTON ST. GALLEN 3.125%/04-03.02.2020		300 000		300 000	345 300.00	0.03
3.75	KANTON ST. GALLEN 3.75%/98-09.04.2018	650 000	150 000		800 000	886 400.00	0.07
0.32	KANTON TESSIN 0.32%/14-18.05.2018	870 000	5 500 000		6 370 000	6 475 105.00	0.49
0.625	KANTON TESSIN 0.625%/13-21.03.2019	300 000	500 000		800 000	821 600.00	0.06
2.5	KANTON TESSIN 2.5%/05-09.02.2017	925 000			925 000	959 225.00	0.07
2.5	KANTON TESSIN 2.5%/06-31.10.2016	1 290 000			1 290 000	1 328 829.00	0.10
0.5	KANTON ZUERICH 0.5%/12-03.12.2020		500 000		500 000	520 250.00	0.04
2.375	KANTON ZUERICH 2.375%/05-03.02.2016	1 480 000		1 480 000			
2.75	KANTON ZUERICH 2.75%/04-24.11.2017	1 800 000	250 000		2 050 000	2 202 725.00	0.17
0.5	KANTON ZURICH 0.5%/13-06.06.2019	2 050 000	500 000		2 550 000	2 635 425.00	0.20
2	KERNKRAFTWERK LEIBSTADT 2%/10-29.03.2016	1 230 000		1 230 000			
2.5	KERNKRAFTWERK LEIBSTADT 2.5%/10-29.03.2019	665 000	300 000		965 000	1 026 760.00	0.08
2.375	KRAFTWERK AMSTEG 2.375%/06-09.03.2018	390 000			390 000	412 230.00	0.03
2.125	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 2.125%/10-10.03.2017	1 780 000			1 780 000	1 835 180.00	0.14
3.375	KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN 3.375%/08-06.06.2016	465 000		465 000			
2.75	KRAFTWERKE OBERHASLI 2.75%/05-04.04.2017	1 060 000			1 060 000	1 103 460.00	0.08
1.5	KUONI REISEN HOLDINGS 1.5%/13-28.10.2019	530 000	500 000		1 030 000	1 042 875.00	0.08
0.5	LINDT & SPRUENGLI 0.5%/14-08.10.2020	2 000 000	6 000 000	3 150 000	4 850 000	4 968 825.00	0.37
3	LONZA GROUP 3%/10-02.06.2016	1 880 000		1 880 000			
2	LONZA SWISS FINANCE 2%/12-11.10.2018	1 000 000			1 000 000	1 048 000.00	0.08
2.25	LONZA SWISS FINANCE 2.25%/11-07.12.2015	600 000		600 000			
1.75	LONZA SWISS FINANZ 1.75%/13-10.04.2019	1 600 000			1 600 000	1 660 800.00	0.12
2.375	LUZERNER KANTONALBANK 2.375%/09-10.09.2018	1 000 000	1 800 000		2 800 000	3 018 400.00	0.23
2.625	LUZERNER KANTONALBANK 2.625%/05-25.11.2020		250 000		250 000	284 750.00	0.02
2.75	LUZERNER KANTONALBANK 2.75%/06-15.11.2016	800 000			800 000	829 520.00	0.06
3.375	LUZERNER KANTONALBANK 3.375%/07-05.07.2019	800 000			800 000	907 600.00	0.07
1.5	MOBIMO HOLDING 1.5%/13-29.10.2018	900 000			900 000	933 300.00	0.07
1.25	OC OERLIKON CORP 1.25%/14-17.06.2019	1 350 000	425 000		1 775 000	1 806 950.00	0.14
4.25	OC OERLIKON CORP 4.25%/12-13.07.2016	1 185 000		500 000	685 000	707 536.50	0.05
0.25	PFANDBRIEFBANK DER SCHWEIZERISCHER KANTONALBANKEN	1 000 000	265 000		1 265 000	1 289 035.00	0.10
0.375	PFANDBRIEFBANK S. 577 0.375%/12-13.07.2018	5 370 000	1 970 000		7 340 000	7 504 416.00	0.56
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 455 000	500 000		1 955 000	1 993 513.50	0.15
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 595 000			3 595 000	3 735 924.00	0.28
0.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 135 000			5 135 000	5 209 971.00	0.39
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 505 000			4 505 000	4 626 184.50	0.35
3.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 600 000	2 700 000		5 300 000	5 849 610.00	0.44
0.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 070 000			3 070 000	3 097 323.00	0.23
2.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 500 000	400 000		2 900 000	3 230 600.00	0.24
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 350 000	3 620 000		7 970 000	8 209 100.00	0.62
0.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		500 000		500 000	507 050.00	0.04
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 600 000	1 000 000		4 600 000	5 111 060.00	0.38
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 495 000		600 000	3 895 000	4 000 944.00	0.30
2.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 600 000			5 600 000	6 254 640.00	0.47
0.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 500 000	1 655 000		3 155 000	3 269 526.50	0.25

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 295 000		3 295 000			
3	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 320 000			4 320 000	4 590 000.00	0.34
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 700 000	800 000		3 500 000	3 916 500.00	0.29
0.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 620 000		1 620 000			
2.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	4 720 000			4 720 000	5 004 616.00	0.38
0.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 970 000			2 970 000	3 000 888.00	0.23
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 750 000	1 090 000		3 840 000	3 948 288.00	0.30
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		250 000		250 000	283 375.00	0.02
2.75	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 500 000	1 250 000		2 750 000	3 157 275.00	0.24
0.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	400 000	4 000 000		4 400 000	4 463 800.00	0.33
0.5	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		1 600 000		4 410 000	4 505 697.00	0.34
1.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	5 115 000		5 115 000			
1.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	2 250 000	1 900 000		4 150 000	4 349 200.00	0.33
3.25	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 680 000			1 680 000	1 755 768.00	0.13
1.625	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	500 000	650 000		1 150 000	1 251 200.00	0.09
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		2 300 000		2 300 000	2 570 250.00	0.19
1.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE		1 500 000		1 500 000	1 599 750.00	0.12
2.375	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 500 000	400 000		3 900 000	4 328 220.00	0.32
0.875	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 300 000	1 500 000		4 800 000	5 018 400.00	0.38
2	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 330 000		3 330 000			
2.125	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	3 750 000	500 000		4 250 000	4 584 900.00	0.34
2	PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE	1 000 000	1 000 000		2 000 000	2 182 800.00	0.16
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	800 000	3 000 000		3 800 000	3 910 580.00	0.29
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 535 000			3 535 000	3 660 492.50	0.27
1.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 500 000	500 000		5 000 000	5 422 500.00	0.41
0.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		2 000 000	2 000 000			
2.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 750 000	400 000		2 150 000	2 359 625.00	0.18
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		1 000 000		1 000 000	1 030 700.00	0.08
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 250 000		3 000 000	250 000	251 775.00	0.02
0.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 190 000			2 190 000	2 219 784.00	0.17
1.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		500 000		500 000	541 200.00	0.04
3.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 700 000	1 200 000	400 000	4 500 000	5 141 250.00	0.39
3.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	860 000	250 000		1 110 000	1 191 585.00	0.09
0.875	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 400 000	2 730 000		5 130 000	5 335 200.00	0.40
2.75	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 240 000	500 000		2 740 000	2 869 876.00	0.22
2.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 130 000		4 130 000			
3.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	810 000		810 000			
2.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 000 000	2 400 000		4 400 000	4 844 400.00	0.36
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 740 000			1 740 000	1 753 746.00	0.13
1.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	4 430 000	500 000		4 930 000	5 007 401.00	0.38
2	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 600 000	1 750 000		5 350 000	5 668 325.00	0.43
3.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 100 000	3 350 000		4 450 000	4 937 275.00	0.37
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 430 000	1 300 000		2 730 000	3 019 380.00	0.23
1.625	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 795 000	500 000		3 295 000	3 397 145.00	0.25
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	250 000	300 000		550 000	608 520.00	0.05
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN		1 750 000		1 750 000	1 783 600.00	0.13
2.375	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	800 000	1 150 000		1 950 000	2 162 940.00	0.16
0.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	5 285 000	5 200 000		10 485 000	10 741 882.50	0.81
2.5	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	3 545 000			3 545 000	3 675 456.00	0.28
3	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	1 520 000	1 060 000		2 580 000	2 798 010.00	0.21
2.125	PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBAN	2 010 000			2 010 000	2 116 329.00	0.16
0.375	PFANDBRIEFZENTRALE S. 439 0.375%/13-31.10.2017	4 450 000			4 450 000	4 529 210.00	0.34
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 441 0.25%/13-01.12.2017	470 000	250 000		720 000	730 800.00	0.05
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 443 0.25%/14-28.03.2018	970 000	2 720 000		3 690 000	3 750 147.00	0.28
0.25	PFANDBRIEFZENTRALE S. 446 0.25%/14-21.06.2018	1 650 000	2 400 000		4 050 000	4 122 900.00	0.31
1.375	PSP SWISS PROPERTY 1.375%/14-04.02.2020	1 000 000			1 000 000	1 044 000.00	0.08
2.625	PSP SWISS PROPERTY 2.625%/06-16.02.2016	630 000		630 000			
1.375	RAIFFEISEN SCHWEIZ 1.375%/10-21.09.2017	650 000			650 000	671 450.00	0.05
2.125	RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.125%/11-04.02.2019	1 750 000			1 750 000	1 878 625.00	0.14
2.375	RAIFFEISEN SCHWEIZ 2.375%/11-10.05.2018	730 000			730 000	778 910.00	0.06
3.125	RAIFFEISEN SCHWEIZ 3.125%/06-30.05.2016	2 690 000		2 690 000			
2.5	REPOWER 2.5%/09-18.11.2016	1 200 000			1 200 000	1 209 000.00	0.09
1	ROCHE KAPITALMARKT 1%/12-21.09.2018	3 650 000			3 650 000	3 777 750.00	0.28
4.5	ROCHE KAPITALMARKT 4.5%/09-23.03.2017	7 255 000			7 255 000	7 799 125.00	0.58
0.25	SCHAFFHAUSER KANTONALBANK 0.25%/13-28.10.2016	1 020 000			1 020 000	1 027 038.00	0.08
1.25	SCHINDLER HOLDING 1.25%/11-21.11.2016	1 860 000			1 860 000	1 885 854.00	0.14
0.75	SCHWYZER KANTONALBANK 0.75%/1-12.03.2020	1 000 000			1 000 000	1 038 500.00	0.08
0.75	SCHWYZER KANTONALBANK 0.75%/12-05.10.2020		250 000		250 000	260 250.00	0.02
1.5	SCHWYZER KANTONALBANK 1.5%/11-10.02.2017	1 820 000			1 820 000	1 866 410.00	0.14
1.625	SCHWYZER KANTONALBANK 1.625%/10-25.05.2016	1 420 000		1 420 000			
1.875	SCHWYZER KANTONALBANK 1.875%/09-16.12.2015	670 000		670 000			
1.875	SGS 1.875%/10-19.08.2016	2 255 000			2 255 000	2 294 011.50	0.17
2.625	SGS 2.625%/11-08.03.2019	2 800 000			2 800 000	3 046 400.00	0.23
1	SIKA 1%/12-12.07.2018	1 900 000	2 000 000		3 900 000	3 999 450.00	0.30
1.125	SIKA 1.125%/13-14.11.2019	1 500 000			1 500 000	1 562 250.00	0.12
2.875	SIKA 2.875%/06-23.03.2016	790 000		790 000			
0.25	ST. GALLER KANTONALBANK 0.25%/15-28.01.2021		150 000		150 000	152 100.00	0.01
2.5	ST. GALLER KANTONALBANK 2.5%/05-30.11.2017	630 000			630 000	669 060.00	0.05
2.25	ST. GALLER KANTONALBANK 2.25%/10-11.05.2020		200 000		200 000	222 200.00	0.02
2.5	ST. GALLER KANTONALBANK 2.5%/06-12.12.2018	500 000	2 000 000		2 500 000	2 723 750.00	0.20
2	ST. GALLER KANTONALBANK 2%/11-16.12.2019		300 000		300 000	324 000.00	0.02
2.75	ST. GALLER KANTONALBANK 2.75%/04-20.12.2016	1 440 000			1 440 000	1 497 600.00	0.11
3.5	ST. GALLER KANTONALBANK 3.5%/07-27.07.2017	1 490 000			1 490 000	1 597 280.00	0.12
2.625	STADT BERN 2.625%/09-30.01.2019	650 000			650 000	711 750.00	0.05
3	STADT BERN 3%/08-31.03.2016	560 000		560 000			
2.625	STADT BIEL 2.625%/09-12.04.2019	650 000	500 000		1 150 000	1 263 850.00	0.09
0.25	STADT ZÜRICH 0.25%/14-21.08.2019	700 000	500 000		1 200 000	1 222 800.00	0.09
2.125	STADT ZÜRICH 2.125%/05-12.08.2016	1 400 000			1 400 000	1 433 600.00	0.11
2.375	STADT ZÜRICH 2.375%/09-10.09.2018	800 000	1 000 000		1 800 000	1 944 000.00	0.15
2.75	STADT ZÜRICH 2.75%/09-20.02.2019	900 000	400 000		1 300 000	1 437 800.00	0.11
2.25	SULZER 2.25%/11-11.07.2016	1 815 000		750 000	1 065 000	1 081 720.50	0.08
0.576	SWISS AUTO LEASE 2013-1 0.576%/13-23.06.2023	1 075 000		1 075 000			

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2	SWISS CONFEDERATION 2%/05-12.10.2016	19 930 000			19 930 000	20 537 865.00	1.54
2.25	SWISS CONFEDERATION 2.25%/05-06.07.2020	3 000 000	29 700 000	2 000 000	30 700 000	35 025 630.00	2.63
2.5	SWISS CONFEDERATION 2.5%/03-12.03.2016	7 665 000		7 665 000			
3	SWISS CONFEDERATION 3%/03-08.01.2018	35 870 000	2 850 000	500 000	38 220 000	41 621 580.00	3.12
3	SWISS CONFEDERATION 3%/04-12.05.2019	33 200 000	4 400 000		37 600 000	42 826 400.00	3.21
4.25	SWISS CONFEDERATION 4.25%/97-05.06.2017	30 840 000	1 000 000		31 840 000	34 657 840.00	2.60
0.4	SWISS CREDIT CARD ISSUANCE -A- 0.4%/13-15.06.2016	925 000		925 000			
1.125	SWISS LIFE HOLDING 1.125%/13-21.06.2019	2 000 000			2 000 000	2 069 000.00	0.16
1	SWISS PRIME SITE 1%/14-10.12.2019	500 000			500 000	516 250.00	0.04
1.125	SWISS PRIME SITE 1.125%/13-11.07.2018	1 790 000			1 790 000	1 843 700.00	0.14
2	SWISS PRIME SITE 2%/13-21.10.2020		1 400 000		1 400 000	1 484 000.00	0.11
2.125	SWISS REINSURANCE 2.125%/11-22.09.2017	2 840 000			2 840 000	2 967 800.00	0.22
3.25	SWISSCOM 3.25%/09-14.09.2018	7 500 000	1 000 000		8 500 000	9 384 000.00	0.70
3.75	SWISSCOM 3.75%/07-19.07.2017	2 990 000		650 000	2 340 000	2 508 480.00	0.19
4	SWISSCOM 4%/08-17.09.2015	980 000		980 000			
1	SWISSGRID 1%/13-30.01.2020		300 000	300 000			
0.75	SYNGENTA FINANCE 0.75%/14-01.11.2019	500 000			500 000	513 250.00	0.04
3	TESSINER STAATSBANK 3%/07-15.06.2017	700 000			700 000	738 150.00	0.06
0.375	THURGAUER KANTONALBANK 0.375%/14-23.10.2020		120 000		120 000	122 520.00	0.01
1.25	THURGAUER KANTONALBANK 1.25%/10-15.09.2017	1 550 000	1 900 000		3 450 000	3 556 950.00	0.27
3	THURGAUER KANTONALBANK 3%/08-29.01.2016	550 000		550 000			
3.125	UBS 3.125%/06-28.06.2016	2 945 000		2 945 000			
4.125	UBS 4.125%/07-27.12.2017	920 000	1 000 000		1 920 000	2 089 920.00	0.16
1	VALIANT BANK 1%/14-22.11.2019	1 000 000			1 000 000	1 032 500.00	0.08
1	VALIANT BANK AG 1%/12-20.11.2018	1 230 000	1 800 000		3 030 000	3 114 840.00	0.23
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK 2.125%/11-15.04.2019	500 000	1 750 000		2 250 000	2 437 875.00	0.18
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK S. 109 2.125%/10-05.02.2018	1 200 000			1 200 000	1 270 200.00	0.10
1.625	ZUERCHER KANTONALBANK S. 110 1.625%/10-03.03.2016	700 000		700 000			
2.125	ZUERCHER KANTONALBANK S. 111 2.125%/10-12.03.2020	1 400 000			1 400 000	1 542 800.00	0.12
2	ZUERCHER KANTONALBANK S. 117 2%/11-21.01.2021		250 000		250 000	278 250.00	0.02
1.75	ZUERCHER KANTONALBANK S. 118 1.75%/11-29.03.2017	2 450 000			2 450 000	2 528 400.00	0.19
0.25	ZUERCHER KANTONALBANK S. 134 0.25%/15-31.03.2021		780 000		780 000	792 870.00	0.06
1	ZUERCHER KANTONALBANK S.123 1%/11-14.12.2018	1 000 000	1 690 000		2 690 000	2 798 945.00	0.21
1.5	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 1.5%/12-25.06.2	2 850 000			2 850 000	3 001 050.00	0.23
2.25	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 2.25%/11-27.07.	1 965 000			1 965 000	2 047 530.00	0.15
2.375	ZUERICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 2.375%/11-23.11	2 750 000			2 750 000	2 953 500.00	0.22
1.125	ZUGER KANTONALBANK 1.125%/13-29.10.2020		1 000 000		1 000 000	1 059 500.00	0.08
1.75	ZUGER KANTONALBANK 1.75%/10-03.12.2019	400 000			400 000	432 000.00	0.03
2.125	ZUGER KANTONALBANK 2.125%/09-22.12.2017	430 000	1 000 000		1 430 000	1 507 935.00	0.11
3.125	ZURICH 3.125%/08-27.03.2017	1 410 000			1 410 000	1 486 845.00	0.11
0.625	ZURICH INSURANCE 0.625%/14-22.07.2020	1 500 000	2 000 000		3 500 000	3 587 500.00	0.27
1.125	ZURICH VERSICHERUNGS GESELLSCHAFT 1.125%/13-18.09.	1 900 000			1 900 000	1 977 900.00	0.15
						673 068 782.50	50.47
Slowakei							
1.375	SLOVAKIA 1.375%/13-16.10.2019	2 000 000	3 750 000		5 750 000	6 092 125.00	0.46
2.125	SLOVAKIA 2.125%/12-25.04.2018	2 150 000			2 150 000	2 291 900.00	0.17
						8 384 025.00	0.63
Spanien							
2	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2%/05-15.12.2016	1 700 000			1 700 000	1 746 750.00	0.13
2.25	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2.25%/09-07.11.2017	1 310 000	500 000		1 810 000	1 904 120.00	0.14
2.718	TELEFONICA EMISIONES 2.718%/12-14.12.2018	1 000 000	250 000		1 250 000	1 343 125.00	0.10
						4 993 995.00	0.37
Südafrika							
2	FIRSTRAND BANK 2%/14-28.05.2019	1 250 000			1 250 000	1 268 750.00	0.10
						1 268 750.00	0.10
Südkorea							
1.125	EXPORT-IMPORT BK KOREA 1.125%/14-03.09.2019	250 000			250 000	260 000.00	0.02
0.5	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 0.5%/14-20.10.2017	2 300 000	500 000		2 800 000	2 807 000.00	0.21
2.5	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 2.5%/12-15.02.2017	1 105 000			1 105 000	1 142 017.50	0.09
3	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 3%/11-27.05.2016	120 000		120 000			
1.5	KEPCO 1.5%/13-23.04.2019	900 000			900 000	933 750.00	0.07
1	KOREA DEVELOPMENT BANK 1%/12-21.12.2018	2 000 000	4 800 000		6 800 000	6 973 400.00	0.52
1	KOREA DEVELOPMENT BANK 1%/12-29.10.2018	400 000			400 000	410 200.00	0.03
1.375	KOREA DEVELOPMENT BANK 1.375%/13-02.07.2018	1 200 000	1 000 000		2 200 000	2 274 800.00	0.17
1.5	KOREA DEVELOPMENT BANK 1.5%/12-23.05.2016	720 000		720 000			
0.75	KOREA DISTRICT HEATING 0.75%/13-20.12.2016	400 000			400 000	402 960.00	0.03
1.125	KOREA GAS 1.125%/13-12.02.2020	500 000	225 000		725 000	753 275.00	0.06
2	KOREA GAS 2%/11-11.10.2016	2 375 000			2 375 000	2 423 687.50	0.18
1	KOREA LAND & HOUSING CORPORATION 1%/13-04.10.2016	500 000			500 000	505 050.00	0.04
2.125	KOREA LAND & HOUSING CORPORATION 2.125%/11-12.12.2	970 000			970 000	995 123.00	0.07
1.625	KOREA NATIONAL OIL 1.625%/13-29.11.2018	3 000 000			3 000 000	3 120 000.00	0.23
1.875	KOREA NATIONAL OIL 1.875%/12-08.03.2017	2 570 000			2 570 000	2 636 820.00	0.20
1	KOREA RAILROAD 1%/12-16.11.2018	1 750 000			1 750 000	1 793 750.00	0.13
1.5	KOREA RAILROAD 1.5%/13-02.12.2019	1 500 000	250 000		1 750 000	1 823 500.00	0.14
1.625	KOREA WESTERN POWER 1.625%/13-26.03.2019	1 000 000			1 000 000	1 039 500.00	0.08
2	LG ELECTRONICS 2%/12-02.12.2016	935 000			935 000	952 952.00	0.07
1.75	SK TELECOM 1.75%/12-12.06.2017	680 000			680 000	696 660.00	0.05
						31 944 445.00	2.40
Tschechische Republik							
2.875	CZECH REPUBLIC 2.875%/09-23.11.2016	2 080 000			2 080 000	2 161 744.00	0.16
						2 161 744.00	0.16
USA							
2.75	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 2.75%/06-21.12.2016	430 000		430 000			
3.375	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP 3.375%/07-29.06.2017	600 000		600 000			
0.5	AT&T 1.875%/14-04.12.2019	2 400 000			2 400 000	2 431 200.00	0.18
2.5	BANK OF AMERICA 2.5%/05-28.09.2017	980 000	250 000		1 230 000	1 292 115.00	0.10
3	BANK OF AMERICA 3%/10-23.12.2016	910 000			910 000	946 855.00	0.07
3.25	BANK OF AMERICA 3.25%/06-14.06.2016	810 000		810 000			
2.375	CITIGROUP 2.375%/05-23.09.2015	790 000			790 000		
3	CITIGROUP 3%/07-21.03.2019	750 000		750 000			
4.875	CREDIT SUISSE NEW YORK BRANCH (subordinated) 4.875	2 960 000	3 850 000		6 810 000	7 565 910.00	0.57
1.625	GECC 1.625%/12-19.10.2017	2 770 000		700 000	2 070 000	2 155 905.00	0.16

Titelbezeichnung		28.02.2015 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ¹	31.08.2015 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.25	GECC 2.25%/11-19.12.2016	3 260 000			3 260 000	3 363 342.00	0.25
2.5	GECC 2.5%/06-08.02.2018	2 300 000			2 300 000	2 451 800.00	0.18
2.625	GECC 2.625%/10-20.01.2016	1 610 000		1 610 000			
2.875	GECC 2.875%/07-27.02.2017	1 760 000	500 000		2 260 000	2 369 610.00	0.18
3	GECC 3%/04-16.10.2015	850 000		850 000			
3.125	GECC 3.125%/04-06.12.2019	3 500 000	250 000		3 750 000	4 237 500.00	0.32
3.375	GECC 3.375%/06-19.06.2018	620 000			620 000	679 830.00	0.05
4.5	GECC 4.5%/08-09.10.2018	1 000 000			1 000 000	1 141 000.00	0.09
1.25	GOLDMAN SACHS GROUP 1.25%/14-11.09.2019	1 300 000			1 300 000	1 353 950.00	0.10
1.5	GOLDMAN SACHS GROUP 1.5%/12-29.11.2018	1 650 000	1 000 000		2 650 000	2 759 975.00	0.21
1.625	GOLDMAN SACHS GROUP S. -F- 1.625%/13-06.02.2020	1 500 000			1 500 000	1 591 500.00	0.12
3.25	HSBC FINANCE 3.25%/06-14.07.2016	2 310 000		1 000 000	1 310 000	1 349 300.00	0.10
5.5	IBRD 5.5%/86-05.02.2016	570 000		570 000			
2.75	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMEN	2 350 000			2 350 000	2 643 750.00	0.20
1.125	JPMORGAN CHASE 1.125%/14-06.11.2020		250 000		250 000	261 625.00	0.02
1.875	MCDONALD'S 1.875%/10-23.06.2016	1 200 000		1 200 000			
0.75	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.75%/14-1704.201	1 800 000	2 550 000		4 350 000	4 467 450.00	0.33
3.125	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 3.125%/06-27.06	940 000		940 000			
2.5	MORGAN STANLEY 2.5%/05-17.11.2015	3 000 000		3 000 000			
3.125	MORGAN STANLEY 3.125%/06-21.11.2018	330 000			330 000	362 340.00	0.03
2.625	NESTLE HOLDINGS 2.625%/07-14.02.2018	1 240 000			1 240 000	1 331 760.00	0.10
0.5	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.5%/14-13.05.2019	1 500 000	1 000 000		2 500 000	2 533 750.00	0.19
0.75	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 0.75%/0.75%/14-16.12.	1 550 000			1 550 000	1 588 750.00	0.12
0.875	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 0.875%/13-11.03.2019	1 000 000	1 000 000		2 000 000	2 054 000.00	0.15
1	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1%/11-06.12.2016	3 850 000			3 850 000	3 898 125.00	0.29
2.875	TOYOTA MOTOR CREDIT 2.875%/06-20.09.2016	3 575 000			3 575 000	3 693 690.00	0.28
						58 525 032.00	4.39
Venezuela							
2.75	CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.75%/11-03.02.2017	845 000			845 000	880 067.50	0.07
						880 067.50	0.07
Vereinigte Arabische Emirate							
3	FIRST GULF BANK 3%/11-16.02.2016	540 000		540 000			
						0.00	0.00
Vereinigtes Königreich							
2.125	ANZ NATIONAL INTERNATIONAL LIMITED 2.125%/11-25.02	440 000		440 000			
0.875	ANZ NEW ZEALAND 0.875%/13-14.02.2019	600 000	2 200 000		2 800 000	2 881 200.00	0.22
1	ANZ NEW ZEALAND 1%/14-10.03.2020		300 000		300 000	312 150.00	0.02
1.5	ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 1.5%/12-27.02.2018	1 890 000	2 050 000		3 940 000	4 123 210.00	0.31
1.125	ASB FINANCE 1.125%/14-05.02.2020		1 500 000		1 500 000	1 570 500.00	0.12
0.875	ASB FINANCE LONDON 0.875%/13-11.06.2019	1 100 000			1 100 000	1 137 950.00	0.09
2.125	ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH 2.125%/10-17.11.2016	1 180 000			1 180 000	1 210 562.00	0.09
1.375	ASB FINANCE LTD LONDON BRANCH S. 2 1.375%/12-02.11	250 000	2 700 000		2 950 000	3 093 075.00	0.23
3	BANK OF SCOTLAND 3%/06-26.05.2016	1 050 000		1 050 000			
2.5	BARCLAYS BANK 2.5%/11-29.03.2016	970 000		970 000			
1.125	BNZ INTERNATIONAL FUNDING 1.125%/12-20.09.2019	1 300 000	500 000		1 800 000	1 877 400.00	0.14
3	BP CAPITAL MARKETS 3%/07-14.06.2017	470 000			470 000	494 675.00	0.04
2.75	BRADFORD & BINGLEY 2.75%/06-16.10.2018	740 000			740 000	806 600.00	0.06
3	BRADFORD & BINGLEY 3%/06-01.06.2016	875 000		875 000			
0.375	CREDIT AGRICOLE 0.375%/15-27.01.2020	700 000	330 000		1 030 000	1 036 695.00	0.08
1.875	HSBC BANK 1.875%/10-01.09.2016	2 250 000			2 250 000	2 300 850.00	0.17
2.375	HSBC BANK 2.375%/11-04.04.2018	1 790 000	400 000		2 190 000	2 330 160.00	0.17
2.75	HSBC BANK 2.75%/07-03.04.2017	1 750 000	500 000		2 250 000	2 356 875.00	0.18
3.375	STATE BANK OF INDIA 3.375%/11-22.02.2016	500 000		500 000			
2.75	THE ROYAL BANK OF SCOTLAND 2.75%/10-08.10.2015	770 000		770 000			
1.875	WESTPAC SECURITIES NZ LTD LONDON BRANCH 1.875%/10-	400 000		400 000			
						25 531 902.00	1.91
Total Obligationen						1 319 114 615.00	98.91
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 319 114 615.00	98.91
Total Anlagen						1 319 114 615.00	98.91
Bankguthaben auf Sicht						1 117 101.13	0.08
Sonstige Vermögenswerte						13 462 898.52	1.01
Gesamtfondsvermögen (GFV)						1 333 694 614.65	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						0.41	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						34 609.05	0.00
Nettofondsvermögen						1 333 660 005.19	100.00

¹ Umfassen Käufe und Verkäufe sowie Corporate Actions

Gemäss § 18 des Fondsreglements wurden in der Berichtsperiode folgende Anteile gegen Effekten statt in bar ausgegeben bzw. zurückgenommen:

Klasse	Datum	Anteile	Währung	NAV	Ausgabe	Rücknahme
Z	24.03.2015	2 475.326	CHF	1 010.65	x	
Z	20.05.2015	10 440.769	CHF	990.90	x	
Z	22.05.2015	4 562.110	CHF	991.36	x	
Z	12.06.2015	10 100	CHF	992.15		x
Z	18.06.2015	12 602.012	CHF	992.55	x	
Z	21.07.2015	9 243.577	CHF	992.35	x	
Z	21.07.2015	11 254.101	CHF	993.35	x	
D	21.07.2015	37 377.577	CHF	992.01	x	

Erläuterungen zum Halbjahres- bericht per 31. August 2015

Erläuterung 1: Verkaufsrestriktionen USA

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen dieses Umbrella-Fonds im Ausland kommen die dort geltenden anlagefonds- und steuerrechtlichen Bestimmungen zur Anwendung.

Anteile dieses Umbrella-Fonds dürfen innerhalb der USA weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Anlegern mit amerikanischer Staatsangehörigkeit bzw. Anlegern, die der amerikanischen Einkommenssteuer unterliegen, wird deshalb empfohlen, vor dem Kauf der Anteile des Anlagefonds einen Steuerberater zu konsultieren. Ein solcher Kauf könnte unter amerikanischem Steuerrecht für den Anleger nachteilige Folgen haben. Die Fondsleitung stellt den Anlegern keine Auskunft zwecks einer «Qualified Electing Fund Election» gemäss § 1293 des US Internal Revenue Code zur Verfügung.

Erläuterung 2: Kennzahlen und technische Daten

Fondsname	Anteil- klasse	Valor	Wäh- rung	pauschale Verwaltungs- kommission ¹	Total Expense Ratio (TER) ²
CSIF Europe ex CH Index Blue	D	10 097 570	CHF	0.0865	0.0865
CSIF Europe ex CH Index Blue	F	20 260 325	CHF	0.15	0.15
CSIF Europe ex CH Index Blue	Z	10 052 326	CHF	0.00	0.00
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	D	1 540 866	CHF	0.084	0.084
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	F	10 175 434	CHF	0.15	0.15
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	Z	3 384 635	CHF	0.00	0.00
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	D	3 894 352	CHF	0.084	0.084
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	F	10 175 438	CHF	0.15	0.15
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	Z	3 900 305	CHF	0.00	0.00
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	D	18 998 679	CHF	0.084	0.084
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	F	18 998 833	CHF	0.15	0.15
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	Z	18 998 442	CHF	0.00	0.00
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	D	21 497 528	CHF	0.084	0.084
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	F	21 497 533	CHF	0.15	0.15
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	Z	21 497 436	CHF	0.00	0.00

¹ Information betreffend SFAMA-Richtlinie für Transparenz bei Verwaltungskommissionen: Die Fondsleitung kann aus dem Bestandteil Vertrieb der Verwaltungskommission an folgende institutionelle Anleger, welche bei wirtschaftlicher Betrachtungsweise die Fondsanteile für Dritte halten, Rückvergütungen bezahlen: Lebensversicherungsgesellschaften, Pensionskassen und andere Vorsorgeeinrichtungen, Anlagengestiftungen, schweizerische Fondsleitungen, ausländische Fondsleitungen und -gesellschaften und Investmentgesellschaften. Sodann kann die Fondsleitung aus dem Bestandteil Vertrieb an die nachstehend bezeichneten Vertriebspartner und -partner Bestandespflegekommissionen bezahlen: bewilligte Vertriebspartner, Fondsleitungen, Banken, Effektenhändler, die Schweizerische Post sowie Versicherungsgesellschaften, Vertriebspartner, die Fondsanteile ausschliesslich bei institutionellen Anlegern mit professioneller Tresorerie platzieren, Vermögensverwalter. Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen oder Vereinbarungen betreffend Retrozessionen in Form von sogenannten «soft commissions» geschlossen.

² Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Fondsvermögen belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens. Allfällige Rückvergütungen/Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Fonds gutgeschrieben und reduzieren somit die TER.

Erläuterung 3: Fondsperformance

Fondsname/Benchmark	Anteil- klasse	Lancierungs- datum	Valor	Wäh- rung	01.01.2015– 31.08.2015 ¹	kum. seit Lancierung	2014 ¹	2013 ¹	2012 ¹
CSIF Europe ex CH Index Blue	D	20.04.2009	10 097 570	CHF	–3.8%	–	3.8%	21.4%	16.3%
MSCI Europe ex Switzerland Index				CHF	–3.8%	–	3.8%	21.5%	16.4%
CSIF Europe ex CH Index Blue	F	20.12.2012	20 260 325	CHF	–3.9%	20.1%	3.7%	21.4%	–
MSCI Europe ex Switzerland Index				CHF	–3.8%	–	3.8%	21.5%	–
CSIF Europe ex CH Index Blue	Z	06.04.2009	10 052 326	CHF	–3.8%	–	3.8%	21.5%	16.4%
MSCI Europe ex Switzerland Index				CHF	–3.8%	–	3.8%	21.5%	16.4%
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	D	14.03.2003	1 540 866	CHF	2.2%	–	7.8%	–2.3%	3.5%
SBI® Total AAA-AA Total Return				CHF	2.3%	–	7.8%	–2.2%	3.5%
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	F	08.06.2009	10 175 434	CHF	2.2%	–	7.7%	–2.3%	3.4%
SBI® Total AAA-AA Total Return				CHF	2.3%	–	7.8%	–2.2%	3.5%
CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue	Z	21.09.2007	3 384 635	CHF	2.3%	–	7.9%	–2.2%	3.6%
SBI® Total AAA-AA Total Return				CHF	2.3%	–	7.8%	–2.2%	3.5%
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	D	15.04.2008	3 894 352	CHF	1.9%	–	6.8%	–1.4%	4.0%
SBI® Total AAA-BBB Total Return				CHF	1.9%	–	6.8%	–1.3%	4.2%
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	F	05.06.2009	10 175 438	CHF	1.9%	–	6.7%	–1.4%	3.9%
SBI® Total AAA-BBB Total Return				CHF	1.9%	–	6.8%	–1.3%	4.2%
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue	Z	15.04.2008	3 900 305	CHF	2.0%	–	6.9%	–1.3%	4.1%
SBI® Total AAA-BBB Total Return				CHF	1.9%	–	6.8%	–1.3%	4.2%
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	D	17.07.2012	18 998 679	CHF	1.2%	7.6%	4.7%	0.3%	–
SBI Foreign AAA-BBB Total Return				CHF	1.2%	–	4.8%	0.4%	–
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	F	23.08.2012	18 998 833	CHF	1.2%	6.8%	4.6%	0.2%	–
SBI Foreign AAA-BBB Total Return				CHF	1.2%	–	4.8%	0.4%	–
CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue	Z	05.10.2012	18 998 442	CHF	1.3%	6.9%	4.8%	0.4%	–
SBI Foreign AAA-BBB Total Return				CHF	1.2%	–	4.8%	0.4%	–
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	D	10.06.2013	21 497 528	CHF	0.7%	2.7%	1.4%	–	–
SBI AAA-BBB 1-5 Y Total Return				CHF	0.8%	–	1.5%	–	–
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	F	17.06.2013	21 497 533	CHF	0.7%	2.5%	1.4%	–	–
SBI AAA-BBB 1-5 Y Total Return				CHF	0.8%	–	1.5%	–	–

Fondsname/Benchmark	Anteil- klasse	Lancierungs- datum	Valor	Wäh- rung	01.01.2015– 31.08.2015 ¹	kum. seit Lancierung	2014 ¹	2013 ¹	2012 ¹
CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue	Z	10.06.2013	21 497 436	CHF	0.8%	3.0%	1.5%	–	–
SBI AAA-BBB 1-5 Y Total Return				CHF	0.8%	–	1.5%	–	–

Quelle: Lipper, a Thomson Reuters company

¹ Die Fondsperformance basiert auf offiziellen publizierten Nettoinventarwerten, die auf den Börsenschlusskursen des jeweiligen Monatsendes basieren.

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Erläuterung 4: Bewertung des Fondsvermögens und der Anteile

1. Der Nettoinventarwert eines Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie mindestens für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden (siehe § 17 Ziff. 1) sowie am letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen 25% oder mehr der Anlagemärkte geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), kann die Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens ausgesetzt werden, es sei denn, es handelt sich um den letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen sind grundsätzlich mit dem am Hauptmarkt bezahlten, gestellten (Geld- resp. Briefkurs) oder berechneten Kurs (Mittelkurs) oder mit dem Kurs gemäss Indexprovider zu bewerten. Andere 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. Vorbehalten bleiben die Bestimmungen von Ziff. 4 unten.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden 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 offenstehenden 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 Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, 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 des Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Teilvermögens, die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die jeweils kleinste gängige Einheit der Rechnungseinheit gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilklasse 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 Anteilklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilklassen 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 Anteilklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

- d) bei der Inventarberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilklasse oder im Interesse mehrerer Anteilklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Erläuterung 5: Änderungen des Fondsvertrags per 23. März 2015

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA hat die von der Fondsleitung und der Depotbank beantragten Änderungen des Fondsvertrags mit Verfügung vom 10. März 2015 bewilligt. Die Änderungen sind per 23. März 2015 in Kraft getreten. Die Publikation auf der elektronischen Plattform Swiss Fund Data (www.swissfunddata.ch) am 5. Februar 2015 und am 4. März 2015 lautete wie folgt:

Publikation vom 5. Februar 2015

A. Anpassung des Fondsvertrags

Die Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigt, nachfolgende Änderungen im Fondsvertrag des CSIF Umbrella Fonds vorzunehmen:

1. **Umbenennung von Teilvermögen**

Bisheriger Name des Teilvermögens	Neuer Name des Teilvermögens
CSIF Inflation-Linked Bond EUR ex Italy Index Blue	CSIF Inflation-Linked Bond EUR ex Italy ex Spain Index Blue
CSIF Inflation-Linked Bond World ex Japan ex Italy Index Blue	CSIF Inflation-Linked Bond World ex Japan ex Italy ex Spain Index Blue
2. **Umbenennung der Anteilklassen (§ 6 des Fondsvertrags)**

Bisheriger Name der Anteilklasse	Neuer Name der Anteilklasse
«D»	«DA»
«DH»	«DAH»
«F»	«FA»
«FH»	«FAH»
«Z»	«ZA»
«ZH»	«ZAH»
3. **Änderung der Anlagepolitik (§ 8 des Fondsvertrags)**
 - 3.1. Ziff. 3 lautet neu wie folgt: Die Fondsleitung darf beim CSIF Europe ex CH Real Estate Index, beim CSIF Asia Real Estate Index und beim CSIF Switzerland Real Estate Fund Index Blue in Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen investieren, die von ihr oder von einer ihr nahestehenden Gesellschaft verwaltet werden. Im Umfang von solchen Anlagen gelten die Bestimmungen bezüglich Ausgabe- und Rücknahmekommission und maximale Verwaltungskommission der Zielfonds gemäss § 20 Ziffer 5 und 6.
 - 3.2. Ziff. 13, Ziff. 16 und Ziff. 18: der jeweils letzte Absatz dieser Ziffern lautet neu wie folgt: Dieses Teilvermögen dient auch als Umbrella-Zielfonds für die Teilvermögen CSIF World ex CH Index Blue und CSIF III World ex CH Index Blue – Pension Fund (Dachfonds). Diese Dachfonds dürfen gemäss ihrer Risikoverteilungsvorschriften (§ 15 Ziff. 8, 13 und 14) jeweils bis zu 100% der Anteile dieser Umbrella-Zielfonds erwerben. Bezüglich der damit zusammenhängenden Risiken wird auf § 15 Ziff. 8 verwiesen.
 - 3.3. Ziff. 15 und Ziff. 17: der jeweils letzte Absatz dieser Ziffern lautet neu wie folgt: Dieses Teilvermögen dient auch als Umbrella-Zielfonds für die Teilvermögen CSIF World ex CH Index und CSIF III World ex CH Index – Pension Fund (Dachfonds). Diese Dachfonds dürfen gemäss ihrer Risikoverteilungsvorschriften (§ 15 Ziff. 8, 13 und 14) jeweils bis zu 100% der Anteile dieser Umbrella-Zielfonds erwerben. Bezüglich der damit zusammenhängenden Risiken wird auf § 15 Ziff. 8 verwiesen.
 - 3.4. Ziff. 19: der letzte Absatz lautet neu wie folgt: Dieses Teilvermögen dient auch als Umbrella-Zielfonds für die Teilvermögen CSIF World ex CH Index, CSIF World ex CH Index Blue, CSIF III World ex CH Index – Pension Fund und CSIF III World ex CH Index Blue – Pension Fund (Dachfonds). Diese Dachfonds dürfen gemäss ihrer Risikoverteilungsvorschriften (§ 15 Ziff. 8, 13 und 14) jeweils bis zu 100% der Anteile dieser Umbrella-Zielfonds erwerben. Bezüglich der damit zusammenhängenden Risiken wird auf § 15 Ziff. 8 verwiesen.
 - 3.5. Ziff. 50: Das Teilvermögen CSIF Inflation-Linked Bond EUR ex Italy ex Spain Index Blue (bisheriger Name des Teilvermögens: CSIF Inflation-Linked Bond EUR ex Italy Index Blue) bildet in seinen Anlagen neu den Referenzindex Barclays Euro Government Inflation-Linked Ex-Italy Ex-Spain Index nach (bisheriger Referenzindex: Barclays Euro Government Inflation-Linked Ex-Italy Index). Diese Änderung wird in der gesamten Anlagepolitik nachvollzogen.
 - 3.6. Ziff. 51: Das Teilvermögen CSIF Inflation-Linked Bond World ex Japan ex Italy ex Spain Index Blue (bisheriger Name des Teilvermögens: CSIF Inflation-Linked Bond World ex Japan ex Italy Index Blue) bildet in seinen Anlagen neu den Referenzindex Barclays World Government Inflation-Linked Ex-Japan Ex-Italy Index. Diese Änderung wird in der gesamten Anlagepolitik nachvollzogen.
4. **Ergänzung der Ausführungen zur Berechnung des Nettoinventarwertes (§ 16 des Fondsvertrags)**

Bisheriger Wortlaut Ziff. 1: Der Nettoinventarwert eines Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie mindestens für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden (siehe § 17 Ziff. 1) sowie am letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt, es sei denn, es handelt sich um den letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats.	Neuer Wortlaut Ziff. 1: Der Nettoinventarwert eines Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie mindestens für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden (siehe § 17 Ziff. 1) sowie am letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen 25% oder mehr der Anlagemärkte eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt, es sei denn, es handelt sich um den letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats.
---	--
5. **Ergänzung bzw. Änderung der Ausführungen zur Ausgabe und Rücknahme von Anteilen (§ 17 des Fondsvertrags)**

Bisheriger Wortlaut Ziff. 1: [...] Anteile der Teilvermögen werden an jedem Bankwerktag (Montag bis Freitag) ausgegeben oder zurück genommen. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen Feiertagen (Ostern, Pfingsten, Weihnachten (inklusive 24. Dezember), Neujahr (inklusive 31. Dezember), Nationalfeiertag, etc.) statt sowie an Tagen, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind (vgl. § 16 Ziff. 1). [...]	Neuer Wortlaut Ziff. 1: [...] Anteile der Teilvermögen werden an jedem Bankwerktag (Montag bis Freitag) ausgegeben oder zurück genommen. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen Feiertagen (Ostern, Pfingsten, Weihnachten (inklusive 24. Dezember), Neujahr (inklusive 31. Dezember), Nationalfeiertag, etc.) statt sowie an Tagen, an welchen 25% oder mehr der Anlagemärkte oder Anteile der Zielfonds des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind (vgl. § 16 Ziff. 1). Zusätzlich finden bei Teilvermögen, welche gemäss Tabelle 1 am nächsten Tag investieren, d.h. deren Bewertung 2 Tage nach der Zeichnung/Rücknahme erfolgt, keine Ausgaben oder Rücknahmen statt, sofern am folgenden Bankwerktag 25% oder mehr der Anlagemärkte oder Anteile der Zielfonds des betroffenen Teilvermögens geschlossen sind oder es sich um einen definierten schweizerischen Feiertag handelt. Diese Zeichnungs- und Rücknahmeanträge werden auf den nächsten Bewertungstag vorgetragen. [...]
---	---

B. Änderungen im Anhang zum Fondsvertrag**1. Wechsel des Publikationsorgans**

Das bisherige Publikationsorgan Swiss Fund Data wird als Publikationsorgan durch die Internet Plattform fundinfo (www.fundinfo.com) abgelöst. Fortan erfolgen sämtliche Mitteilungen an die Anleger über www.fundinfo.com. Diese Änderung wird entsprechend im Anhang zum Fondsvertrag angepasst.

2. Änderung der Ausführungen in Fussnote 2 zur Tabelle 1 im Anhang zum Fondsvertrag

Bisheriger Wortlaut von Fussnote 2:	Neuer Wortlaut von Fussnote 2:
Die Ausgabe- und Rücknahmespesen werden von der Fondsleitung zugunsten des jeweiligen Teilvermögens erhoben, um die beim Erwerb bzw. bei der Veräusserung der Anlagen anfallenden Investitionskosten zu decken. Es kann vorkommen, dass bei gewissen Transaktionen (Zeichnungen oder Rückgaben) die effektive Höhe der Ausgabe-/Rücknahmespesen gemäss Tabelle 1 die effektiven Kosten für den Erwerb bzw. die Veräusserung der Anlagen nicht decken. In diesem Fall kann die Fondsleitung in eigenem Ermessen die effektive Höhe der Ausgabe-/Rücknahmespesen gemäss Tabelle 1 bis höchstens zum maximalen Spread gemäss § 19 Ziff. 3 des Fondsvertrags zugunsten des jeweiligen Teilvermögens anheben, um so die effektiv anfallenden Kosten für den Erwerb bzw. die Veräusserung der Anlagen zu decken.	Die Ausgabe- und Rücknahmespesen werden von der Fondsleitung zugunsten des jeweiligen Teilvermögens erhoben, um die beim Erwerb bzw. bei der Veräusserung der Anlagen anfallenden Investitionskosten zu decken. Bei gewissen Transaktionen (Zeichnungen oder Rückgaben) kann es vorkommen, dass die effektive Höhe der Ausgabe-/Rücknahmespesen gemäss Tabelle 1 die tatsächlichen Kosten für den Erwerb bzw. die Veräusserung der Anlagen nicht decken oder aber dass die Ausgabe-/Rücknahmespesen gem. Tabelle 1 zu hoch sind. Die Fondsleitung behält sich deshalb das Recht vor, in solchen Fällen die effektive Höhe der Ausgabe-/Rücknahmespesen zugunsten des jeweiligen Teilvermögens zu belasten. Eine solche Belastung kann höher oder tiefer als die durchschnittlichen Ausgabe-/Rücknahmespesen gemäss Tabelle 1 ausfallen, übersteigt aber auf keinen Fall den maximalen Spread gemäss § 19 Ziff. 3 des Fondsvertrags.

Publikation vom 4. März 2015

Die Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse AG, Zürich, als Depotbank, informiert die Anleger des Credit Suisse Institutional Fund (CSIF) Umbrella, dass sie vorerst auf die in der Publikation vom 5. Februar 2015 in den Ziffern 4 (Ergänzung der Ausführungen zur Berechnung des Nettoinventarwerts, § 16 des Fondsvertrags) und 5 (Ergänzung bzw. Änderung der Ausführungen zur Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, § 17 des Fondsvertrags) angekündigten Änderungen im Credit Suisse Institutional Fund (CSIF) Umbrella verzichtet. Unter Vorbehalt der Genehmigung durch die FINMA wird weiterhin beabsichtigt, die übrigen Änderungen gemäss Publikation vom 5. Februar 2015 umzusetzen.

Erläuterung 6: Änderungen des Fondsvertrags per 13. Juli 2015

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA hat die von der Fondsleitung und der Depotbank beantragten Änderungen des Fondsvertrags mit Verfügung vom 2. Juli 2015 bewilligt. Die Änderungen sind per 13. Juli 2015 in Kraft getreten. Die Publikation auf der elektronischen Plattform fundinfo (www.fundinfo.com) am 22. Mai 2015 lautete wie folgt:

Anpassung des Fondsvertrags

Die Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigt, nachfolgende Änderungen im Fondsvertrag des CSIF Umbrella Fonds vorzunehmen:

1. Anteile und Anteilklassen (§ 6 des Fondsvertrags)

Bei den Anteilklassen DA und DAH wird die Negativliste der nicht für diese Klassen qualifizierenden Mandatstypen wie folgt ergänzt: Credit Suisse Invest Anlagelösungen.

2. Anlageziel und Anlagepolitik (§ 8 des Fondsvertrags)

2.1. Die Ausführungen zur Modified Duration wird bei folgenden Teilvermögen angepasst:

- CSIF Switzerland Bond Index AAA-AA Blue;
- CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB Blue;
- CSIF Switzerland Bond Index Domestic AAA-BBB Blue;
- CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue;
- CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue;
- CSIF Bond EUR Index Blue;
- CSIF Bond USD Index Blue;
- CSIF Bond GBP Index Blue;
- CSIF Bond JPY Index Blue;
- CSIF Bond World ex G4 Local Currencies Index Blue;
- CSIF Bond Aggregate EUR Index;
- CSIF Bond Aggregate USD Index;
- CSIF Bond Aggregate GBP Index;
- CSIF Bond Aggregate JPY Index;
- CSIF Bond Global Aggregate ex G4 Local Currencies Index;
- CSIF Bond Global Aggregate ex CHF 1-5 Y Index Blue;
- CSIF Bond Corporate EUR Index;
- CSIF Bond Global Corporate ex CHF Index Blue;
- CSIF Bond Global Corporate ex CHF 1-5Y Index Blue;
- CSIF Bond EUR Fiscal Strength Index Blue;
- CSIF Bond World ex CHF Fiscal Strength Index Blue;
- CSIF Bond World ex CHF Fiscal Strength 1-5Y Index Blue;
- CSIF Inflation-Linked Bond EUR ex Italy ex Spain Index Blue;
- CSIF Inflation-Linked Bond World ex Japan ex Italy ex Spain Index Blue;
- CSIF Bond Emerging Markets Index Blue.

Bisheriger Wortlaut	Neuer Wortlaut
Das Teilvermögen weist eine Modified Duration auf, die nicht mehr als sechs Monate von der Modified Duration des Referenzindex abweicht; [...]	Das Teilvermögen weist eine Modified Duration auf, die nicht mehr als 0.5 von der Modified Duration des Referenzindex abweicht; [...]

2.2. Der Referenzindex, welchen das Teilvermögen CSIF Switzerland Bond Index AAA-BBB 1-5 Y Blue nachbildet, lautet neu wie folgt: SBI® AAA-BBB 1-5 Y Total Return (bisher: SBI® AAA-BBB 1-5 Y).

2.3. Die Anlagepolitik des Teilvermögens CSIF Switzerland Real Estate Fund Index Blue (Ziff. 55) wird um folgenden Passus ergänzt:

Die Fondsleitung investiert gemäss Anlagepolitik einen wesentlichen Teil des Vermögens des Teilvermögens in Immobilienfonds. Bei diesen unterliegenden Immobilienfonds wird der Nettoinventarwert typischerweise lediglich einmal jährlich berechnet, entsprechend werden Anteile dieser Immobilienfonds bei der jeweiligen Fondsleitung lediglich einmal jährlich ausgegeben und zurückgenommen.

Diese Immobilienfonds sind typischerweise an der Börse gelistet und deren Anteile werden täglich zu Marktpreisen gehandelt. Marktbedingungen können dazu führen, dass die Anteile der Immobilienfonds mit hohem Disagio gehandelt werden. Unter solchen Umständen kann es vorkommen, dass es nicht im besten Interesse der Anleger liegt, dass die Anteile der Immobilienfonds an der Börse verkauft werden, sondern die Rücknahme der Anteile über den Primärmarkt erfolgt, wobei die Kündigungsfrist von einem Jahr eingehalten werden müsste. Solche Marktbedingungen können beim Teilvermögen zu Liquiditätsengpässen führen. Als Folge davon ist es möglich, dass die Fondsleitung die täglichen Rücknahmen nicht bedienen kann.

Die Fondsleitung hat als Massnahme zur Minderung dieser Liquiditätsproblematik ein Gating-Verfahren mit einem gewissen Schwellenwert («Gate») eingeführt. Dieses erlaubt der Fondsleitung, Zeichnungs- und Rücknahmeanträge unter bestimmten Voraussetzungen zu kürzen (vgl. § 17 Ziff. 8 und 9). Die Marktbedingungen können dazu führen, dass die Liquidität des Teilvermögens dauerhaft eingeschränkt ist, und die Fondsleitung das Gating-Verfahren über einen längeren Zeitraum einsetzt. Damit kann es zu einer langfristigen Verzögerung bei der Rücknahme von Anteilen und bei der Auszahlung der Rücknahmeerlöse kommen.

Anstelle einer Barauszahlung hat der Anleger bei einem Schwellenwert von CHF 1 Mio. die Möglichkeit, bei der Fondsleitung eine Sachauslage zu beantragen. D.h. der Anleger erhält anteilmässig zu seiner Investition Anlagen (Anteile der Immobilienfonds) aus dem Teilvermögen ausgeliefert (vgl. § 18).

3. Ergänzung bzw. Änderung der Ausführungen zur Berechnung des Nettoinventarwertes (§ 16 des Fondsvertrags)

Bisheriger Wortlaut Ziff. 1: Der Nettoinventarwert eines Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie mindestens für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden (siehe § 17 Ziff. 1) sowie am letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt, es sei denn, es handelt sich um den letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats.	Neuer Wortlaut Ziff. 1: Der Nettoinventarwert eines Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie mindestens für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden (siehe § 17 Ziff. 1) sowie am letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen 25% oder mehr der Anlagemärkte eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), kann die Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens ausgesetzt werden, es sei denn, es handelt sich um den letzten Wochentag (Montag–Freitag) eines jeden Monats.
---	--

4. Ergänzung bzw. Änderung der Ausführungen zur Ausgabe und Rücknahme von Anteilen (§ 17 des Fondsvertrags)

Bisheriger Wortlaut Ziff. 1: [...] Anteile der Teilvermögen werden an jedem Bankwerktag (Montag bis Freitag) ausgegeben oder zurück genommen. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen Feiertagen (Ostern, Pfingsten, Weihnachten (inklusive 24. Dezember), Neujahr (inklusive 31. Dezember), Nationalfeiertag, etc.) statt sowie an Tagen, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind (vgl. § 16 Ziff. 1). [...]	Neuer Wortlaut Ziff. 1: [...] Anteile der Teilvermögen werden an jedem Bankwerktag (Montag bis Freitag) ausgegeben oder zurück genommen. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen Feiertagen (Ostern, Pfingsten, Weihnachten (inklusive 24. Dezember), Neujahr (inklusive 31. Dezember), Nationalfeiertag, etc.) statt. Auch an Tagen, an welchen 25% oder mehr der Anlagemärkte oder Anteile der Zielfonds des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind, kann die Ausgabe oder Rücknahme der Anteile der Teilvermögen ausgesetzt werden (vgl. § 16 Ziff. 1). Zusätzlich kann bei Teilvermögen, welche gemäss Tabelle 1 am nächsten Tag investieren, d.h. deren Bewertung 2 Tage nach der Zeichnung/Rücknahme erfolgt, die Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen ausgesetzt werden, sofern am folgenden Bankwerktag 25% oder mehr der Anlagemärkte oder Anteile der Zielfonds des betroffenen Teilvermögens geschlossen sind oder es sich um einen definierten schweizerischen Feiertag handelt. Diese Zeichnungs- und Rücknahmeanträge werden auf den nächsten Bewertungstag vorgetragen. [...]
---	--

5. Einführung des Gating-Verfahrens für weitere Teilvermögen (§ 17 Ziff. 8 des Fondsvertrags)

In § 17 des Fondsvertrags wird die bestehende Ziffer 8 ergänzt. Für folgende Teilvermögen wird das Gating-Verfahren neu eingeführt:

- CSIF Switzerland Bond Index Foreign AAA-BBB Blue;
- CSIF Switzerland Bond Index Corporate Blue;
- CSIF Bond Corporate EUR Index;
- CSIF Bond Global Corporate ex CHF Index Blue;
- CSIF Bond Global Corporate ex CHF 1-5Y Index Blue;
- CSIF Bond Emerging Markets Index Blue.

Der Schwellenwert für diese Teilvermögen beträgt 50 Mio. in der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens.

Erläuterung 7: Änderung des Fondsvertrags per 6. August 2015 / Liquidation des Teilvermögens CSIF Bond Index Blue

Das Teilvermögen CSIF Bond Index Blue wurde per 9. Juli 2015 liquidiert. Es wurde ein Liquidationsbericht erstellt und der Fondsvertrag angepasst.



Credit Suisse Funds AG

Uetlibergstrasse 231
CH-8070 Zürich

www.credit-suisse.com