



# BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL STAATSANLEIHEN

Halbjahresbericht per 28.02.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
A	30461399	CHF
A hedged	30509114	CHF
B	30817735	CHF
B hedged	30818629	CHF
It	29115621	CHF
It hedged	29115641	CHF
Nt	29115689	CHF
Nt hedged	29115698	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 25.04.2023

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	3
2	Vertriebsorganisation	4
3	Abschlusszahlen	5
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	20
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	21
7	Verwaltungskommission	21
8	Benchmark	21
9	TER	21
10	Fussnoten	22
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied  
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

## Geschäftsleitung

Hans Frey  
Geschäftsführer  
Andreas Hogg  
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services  
Silvia Karrer  
Leiterin Administration & Operations

## Delegationen

Anlageentscheide Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern  
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020	01.09.2019
	bis	28.02.2023	31.08.2022	31.08.2021	31.08.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		262'778'319.23	276'139'609.54	296'113'775.84	336'308'162.58
<b>Klasse A</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		617'547.86	669'814.29	939'798.31	906'199.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'474.000	8'474.000	10'034.000	9'526.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		72.88	79.04	93.66	95.13
Ausschüttung je Anteil		-	1.65	1.40	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
<b>Klasse A hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'820'344.65	1'945'353.48	2'284'009.12	2'446'451.79
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		24'367.834	24'382.783	25'048.000	25'943.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.70	79.78	91.19	94.30
Ausschüttung je Anteil		-	1.45	1.40	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
<b>Klasse B</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		101'036.79	107'940.11	100'750.52	157'023.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000	1'011.000	1'569.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.49	84.93	99.65	100.08
Thesaurierung je Anteil		-	1.57	1.55	1.61
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
<b>Klasse B hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'319'710.20	1'392'814.63	1'866'746.86	1'862'676.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'358.000	16'358.000	19'370.000	18'870.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.68	85.15	96.37	98.71
Thesaurierung je Anteil		-	1.50	1.46	1.48
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
<b>Klasse It</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		82.26	87.80	102.46	102.36
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1.000	1.000	1.000	1.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.26	87.80	102.46	102.36
Thesaurierung je Anteil		-	2.45	2.53	2.50
Total Expense Ratio (TER)		0.22 %	0.23 %	0.22 %	0.22 %
<b>Klasse It hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'521'782.72	5'815'524.49	5'786'196.82	3'149'799.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		66'380.000	66'380.000	58'680.000	31'247.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.18	87.61	98.61	100.80
Thesaurierung je Anteil		-	2.07	2.05	2.08
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %
<b>Klasse Nt</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		76'575'831.23	80'786'090.22	90'787'253.77	92'970'192.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		901'478.465	890'922.741	857'492.070	878'714.039
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.94	90.68	105.88	105.80
Thesaurierung je Anteil		-	2.43	2.46	2.54
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

Klasse Nt hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		176'821'983.52	185'421'984.52	194'348'917.98	234'815'718.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'100'707.431	2'093'419.820	1'954'543.301	2'318'250.718
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.17	88.57	99.43	101.29
Thesaurierung je Anteil		-	2.33	2.32	2.34
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

## Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse A	-14.29 %	-16.36 %	-4.16 %	-1.19 %
Klasse A hedged	-11.69 %	-13.62 %	-3.48 %	1.95 %
Klasse B	-14.29 %	-16.36 %	-4.15 %	-1.19 %
Klasse B hedged	-11.72 %	-13.66 %	-3.53 %	1.94 %
Klasse It	-13.63 %	-15.69 %	-3.28 %	-0.41 %
Klasse It hedged	-10.98 %	-12.92 %	-2.94 %	2.32 %
Klasse Nt	-13.63 %	-15.72 %	-3.41 %	-0.43 %
Klasse Nt hedged	-10.67 %	-12.64 %	-2.64 %	2.76 %
Benchmark Hedge	-11.03 %	-	-	-
Benchmark	-13.80 %	-16.20 %	-3.73 %	-0.05 %
Tracking Error 33)	-	0.56 %	0.43 %	0.62 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

## Tracking Differenz

Klasse	
Klasse A	-0.49 %
Klasse A hedged	-0.66 %
Klasse B	-0.49 %
Klasse B hedged	-0.69 %
Klasse It	0.17 %
Klasse It hedged	0.05 %
Klasse Nt	0.17 %
Klasse Nt hedged	0.36 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	28.02.2023	31.08.2022
Bankguthaben auf Sicht	1'712'709.95	8'924'995.43
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	258'928'926.29	265'113'925.13
Derivative Finanzinstrumente	-15'287.29	1'737.52
Sonstige Vermögenswerte	2'161'624.60	2'111'074.14
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>262'787'973.55</b>	<b>276'151'732.22</b>
Andere Verbindlichkeiten	-9'654.32	-12'122.68
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>262'778'319.23</b>	<b>276'139'609.54</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2022 28.02.2023	01.09.2021 31.08.2022
<b>Klasse A</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'474.000	10'034.000
Zurückgenommene Anteile		-	-1'560.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>8'474.000</b>	<b>8'474.000</b>
<b>Klasse A hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		24'382.783	25'048.000
Ausgegebene Anteile		-	554.783
Zurückgenommene Anteile		-14.949	-1'220.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>24'367.834</b>	<b>24'382.783</b>
<b>Klasse B</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'271.000	1'011.000
Ausgegebene Anteile		-	260.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'271.000</b>	<b>1'271.000</b>
<b>Klasse B hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'358.000	19'370.000
Ausgegebene Anteile		-	468.000
Zurückgenommene Anteile		-	-3'480.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>16'358.000</b>	<b>16'358.000</b>
<b>Klasse It</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1.000	1.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1.000</b>	<b>1.000</b>
<b>Klasse It hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		66'380.000	58'680.000
Ausgegebene Anteile		-	7'700.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>66'380.000</b>	<b>66'380.000</b>
<b>Klasse Nt</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		890'922.741	857'492.070
Ausgegebene Anteile		24'435.429	78'909.114
Zurückgenommene Anteile		-13'879.705	-45'478.443
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>901'478.465</b>	<b>890'922.741</b>
<b>Klasse Nt hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'093'419.820	1'954'543.301
Ausgegebene Anteile		236'801.341	315'421.215
Zurückgenommene Anteile		-229'513.730	-176'544.696
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'100'707.431</b>	<b>2'093'419.820</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.09.2022 28.02.2023	01.09.2021 31.08.2022
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		276'139'609.54	296'113'775.84
Ausbezahlte Ausschüttung		-49'315.46	-47'469.50
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'556'601.67	-2'367'595.66
Saldo aus dem Anteilverkehr		1'684'851.24	14'913'421.26
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-12'440'224.42	-32'472'522.40
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>262'778'319.23</b>	<b>276'139'609.54</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.09.2022 28.02.2023</b>	<b>01.09.2021 31.08.2022</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'939.78	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-5'089.54	-24'101.84
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'500'670.92	7'026'353.17
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		161'354.51	651'060.95
<b>Total Ertrag</b>		<b>3'658'875.67</b>	<b>7'653'312.28</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-1'870.09
Reglementarische Vergütungen		-62'959.02	-137'358.08
Sonstige Aufwendungen		0.00	-348.25
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-182'831.19	-247'777.95
<b>Total Aufwand</b>		<b>-245'790.21</b>	<b>-387'354.37</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>3'413'085.46</b>	<b>7'265'957.91</b>
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-16'787'681.71	1'563'323.72
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		52'431.89	87'818.19
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-13'322'164.36</b>	<b>8'917'099.82</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		881'939.94	-41'389'622.22
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-12'440'224.42</b>	<b>-32'472'522.40</b>



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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>258'928'926.29</b>	<b>98.53</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>258'928'926.29</b>	<b>98.53</b>	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	2'800	0	2'800 AUD	81.78%	1'447'328.76	0.55	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	900	1'300	0	2'200 AUD	105.41%	1'465'645.12	0.56	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	2'100	0	100	2'000 AUD	101.91%	1'288'162.24	0.49	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	1'500	1'500	0	3'000 AUD	89.49%	1'696'880.01	0.65	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	2'500	0	1'500	1'000 AUD	81.75%	516'694.56	0.20	a)
AU3TB0000101	5.5000 % ACGB 5 1/2 04/21/23 133	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	800	0	120	680 AUD	98.85%	424'819.49	0.16	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	1'500	1'200	100	2'600 AUD	97.48%	1'601'944.63	0.61	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	500	0	0	500 AUD	99.29%	313'783.03	0.12	a)
<b>AU</b>							<b>8'755'257.84</b>	<b>3.33</b>	
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	3'100	2'400	1'500	4'000 CAD	99.27%	2'733'469.70	1.04	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	800	0	0	800 CAD	97.69%	537'986.80	0.20	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	0	600	50	550 CAD	89.44%	338'647.78	0.13	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	1'200	0	1'000	200 CAD	96.38%	132'697.17	0.05	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	0	900	0	900 CAD	76.99%	477'019.60	0.18	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	0	600	50	550 CAD	71.66%	271'330.93	0.10	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	900	0	800	100 CAD	117.74%	81'051.18	0.03	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	1'400	0	1'300	100 CAD	113.31%	78'003.54	0.03	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	300	0	100	200 CAD	120.56%	165'989.18	0.06	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	400	0	200	200 CAD	118.82%	163'590.72	0.06	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	300	0	200	100 CAD	103.15%	71'007.13	0.03	a)
<b>CA</b>							<b>5'050'793.73</b>	<b>1.92</b>	
CND100010K57	3.6100 % CGB 3.61 06/07/25 1813	25'000	0	0	25'000 CNY	102.79%	3'464'718.76	1.32	a)
CND10001Q6Q0	4.0800 % CGB 4.08 10/22/48 1824	30'000	0	0	30'000 CNY	113.37%	4'585'388.92	1.74	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	30'000	0	0	30'000 CNY	103.04%	4'167'531.56	1.59	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	0	2'500	0	2'500 CNY	101.04%	340'559.88	0.13	a)
CND100031J20	1.9900 % CGB 1.99 04/09/25 INBK	15'000	0	0	15'000 CNY	98.98%	2'001'800.05	0.76	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	22'000	1'700	0	23'700 CNY	98.70%	3'153'801.36	1.20	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	0	8'000	0	8'000 CNY	101.35%	1'093'135.23	0.42	a)
CND10004GNL8	2.6900 % CGB 2.69 08/12/26 INBK	0	5'000	0	5'000 CNY	100.05%	674'459.50	0.26	a)
CND100058NN1	2.1800 % CGB 2.18 06/25/24 INBK	0	9'000	0	9'000 CNY	99.71%	1'209'913.64	0.46	a)
CND10005JJ69	2.6900 % CGB 2.69 08/15/32 INBK	0	9'200	0	9'200 CNY	98.16%	1'217'537.62	0.46	a)
<b>CN</b>							<b>21'908'846.52</b>	<b>8.34</b>	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	2'000	0	0	2'000 EUR	98.71%	1'962'226.48	0.75	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	3'000	0	2'000	1'000 EUR	93.28%	927'201.11	0.35	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	5'500	0	3'000	2'500 EUR	120.24%	2'987'779.45	1.14	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	2'000	0	1'000	1'000 EUR	114.81%	1'141'159.90	0.43	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	1'600	0	1'000	600 EUR	120.20%	716'858.34	0.27	a)
<b>DE</b>							<b>7'735'225.28</b>	<b>2.94</b>	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	5'000	0	0	5'000 EUR	103.17%	5'127'118.80	1.95	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	750	1'700	0	2'450 EUR	117.62%	2'864'148.83	1.09	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	4'400	1'800	4'000	2'200 EUR	109.02%	2'383'919.90	0.91	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	2'400	0	0	2'400 EUR	99.23%	2'367'052.48	0.90	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	0	1'400	0	1'400 EUR	87.65%	1'219'724.10	0.46	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	0	1'200	0	1'200 EUR	103.93%	1'239'585.31	0.47	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	0	1'000	0	1'000 EUR	65.40%	650'056.60	0.25	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	0	1'500	0	1'500 EUR	63.49%	946'623.00	0.36	a)
<b>ES</b>							<b>16'798'229.02</b>	<b>6.39</b>	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	5'100	0	0	5'100 EUR	113.77%	5'767'044.02	2.19	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	2'200	0	0	2'200 EUR	114.64%	2'506'921.85	0.95	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	2'000	0	0	2'000 EUR	97.35%	1'935'131.26	0.74	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	7'000	0	1'000	6'000 EUR	90.31%	5'385'606.77	2.05	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	2'500	0	0	2'500 EUR	80.26%	1'994'445.54	0.76	a)
<b>FR</b>							<b>17'589'149.44</b>	<b>6.69</b>	
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	700	0	0	700 GBP	104.25%	828'002.21	0.32	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	600	450	0	1'050 GBP	102.27%	1'218'472.85	0.46	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'200	600	0	1'800 GBP	107.67%	2'198'999.54	0.84	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	2'300	0	0	2'300 GBP	102.28%	2'669'375.03	1.02	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	1'500	0	0	1'500 GBP	107.26%	1'825'504.30	0.69	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	690	500	0	1'190 GBP	105.84%	1'429'167.58	0.54	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	1'630	700	0	2'330 GBP	87.17%	2'304'502.02	0.88	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	3'600	0	0	3'600 GBP	62.31%	2'545'272.62	0.97	a)
<b>GB</b>							<b>15'019'296.15</b>	<b>5.72</b>	
IT0004898034	4.5000 % BTPS 4 1/2 05/01/23 10Y	3'500	0	900	2'600 EUR	100.28%	2'591'622.73	0.99	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	0	4'000	0	4'000 EUR	94.15%	3'743'076.02	1.42	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	0	1'500	0	1'500 EUR	89.12%	1'328'704.32	0.51	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	3'000	2'000	0	5'000 EUR	83.23%	4'136'095.83	1.57	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	5'200	0	3'000	2'200 EUR	67.85%	1'483'742.44	0.56	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	2'000	0	0	2'000 EUR	70.47%	1'400'880.37	0.53	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	4'200	900	0	5'100 EUR	91.08%	4'617'001.14	1.76	a)
<b>IT</b>							<b>19'301'122.85</b>	<b>7.34</b>	
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	750'000	1'020'000	50'000	1'720'000 JPY	100.55%	11'899'961.89	4.53	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	1'200'000	540'000	0	1'740'000 JPY	105.64%	12'647'966.40	4.81	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	1'600'000	0	0	1'600'000 JPY	108.01%	11'890'898.67	4.52	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	1'100'000	0	0	1'100'000 JPY	112.15%	8'488'489.92	3.23	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	100'000	0	0	100'000 JPY	107.29%	738'206.44	0.28	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	750'000	0	510'000	240'000 JPY	119.91%	1'980'064.17	0.75	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	650'000	0	50'000	600'000 JPY	113.86%	4'700'598.52	1.79	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	250'000	150'000	50'000	350'000 JPY	108.44%	2'611'561.74	0.99	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	675'000	0	50'000	625'000 JPY	118.77%	5'107'693.36	1.94	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	0	200'000	0	200'000 JPY	112.35%	1'546'127.83	0.59	a)
<b>JP</b>							<b>61'611'568.94</b>	<b>23.45</b>	
NZGOVDT423C0	5.5000 % NZGB 5 1/2 04/15/23 0423	600	0	0	600 NZD	100.07%	348'654.79	0.13	a)
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	400	0	0	400 NZD	95.63%	222'109.84	0.08	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	530	0	0	530 NZD	99.49%	306'193.41	0.12	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	200	0	0	200 NZD	91.69%	106'480.37	0.04	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	600	0	0	600 NZD	94.61%	329'631.94	0.13	a)
<b>NZ</b>							<b>1'313'070.35</b>	<b>0.50</b>	
US912810EQ77	6.2500 % T 6 1/4 08/15/23	560	0	560	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	13'460	2'000	4'500	10'960 USD	104.00%	10'683'150.40	4.07	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	20'650	7'000	20'500	7'150 USD	105.45%	7'066'769.81	2.69	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	455	0	455	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	7'520	1'900	5'000	4'420 USD	109.27%	4'526'486.96	1.72	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	0	5'000	0	5'000 USD	81.25%	3'807'578.13	1.45	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	6'100	3'600	0	9'700 USD	81.58%	7'416'532.48	2.82	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	3'700	1'400	0	5'100 USD	81.78%	3'909'123.30	1.49	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	4'300	10'000	3'300	11'000 USD	67.64%	6'973'579.34	2.65	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	0	5'000	1'000	4'000 USD	65.09%	2'440'364.69	0.93	a)
US912828B667	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	17'000	2'100	7'900	11'200 USD	97.76%	10'261'833.15	3.90	a)
US912828D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	4'800	0	800	4'000 USD	96.21%	3'607'094.50	1.37	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	8'000	8'000	2'000	14'000 USD	94.59%	12'411'093.85	4.72	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	11'800	1'000	11'700	1'100 USD	78.64%	810'765.19	0.31	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	0	25'000	13'200	11'800 USD	89.80%	9'931'994.37	3.78	a)
<b>US</b>							<b>83'846'366.17</b>	<b>31.91</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-15'287.29</b>	<b>-0.01</b>	

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		103'095	91'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.10.2022		10'108	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		427'671	60'750'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		468'859	478'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		49'506	74'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		679'581	698'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		157'278	1'114'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		47'057	63'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		4'000	4'562		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		5'000	4'940		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		4'000	3'942		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		4'826	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		3'845	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		5'727	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		4'021	600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		5'000	4'820		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		2'500	2'805		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'737		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		10'000	9'555		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		6'000	6'446		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		600'000	4'133		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		4'000	4'292		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		5'000	4'973		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		6'000	5'700		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		7'000	6'961		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		4'438	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		1'000'000	6'823		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		155'030	1'114'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		9'463	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		665'788	672'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		408'374	59'750'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		83'265	75'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		45'819	63'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		5'000	4'882		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		448'274	462'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		47'059	74'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		10'000	9'985		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		6'000	5'817		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		3'000	3'310		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		4'955	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		10'000	10'057		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		500'000	3'437		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		15'000	2'116		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		4'000	2'525		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		14'876	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		10'000	10'031		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		7'000	6'998		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		1'000'000	6'768		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		5'675	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		8'854	9'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		149'802	1'099'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		89'077	77'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		9'827	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		46'340	63'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		44'804	70'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		662'831	664'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		392'214	58'250'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		445'574	451'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		6'703	1'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		4'898	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		10'000	10'136		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		7'000	6'946		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		7'867	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		1'000'000	6'758		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		10'000	9'852		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		6'728	7'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		14'132	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		12'659	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		9'493	1'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		5'532	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		7'131	7'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		6'843	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		44'341	63'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		44'636	70'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		407'207	59'650'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		9'987	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		646'621	682'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		459'268	469'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		147'509	1'099'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		93'284	82'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		12'000	11'408		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		8'000	7'864		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		1'500'000	10'271		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		6'530	7'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		10'000	9'264		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		9'000	8'890		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		700'000	4'828		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.01.2023		22'000	2'954		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		13'861	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		6'886	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		12'121	1'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		11'293	10'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		4'333	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		2'622	20'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		8'000	7'925		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		8'000	7'423		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		9'000	8'892		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		13'000	12'226		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		12'000	11'914		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		700'000	5'053		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		4'000	2'782		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		4'000	2'561		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		412'451	58'550'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		40'678	59'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		46'538	73'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		423'380	430'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		147'568	1'097'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		612'661	661'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		9'917	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		103'324	92'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		6'458	7'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		5'878	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		10'050	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'899	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		5'543	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		8'000	7'463		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		1'000'000	7'055		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		42'000	38'979		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		4'000	4'043		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		9'275	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		16'699	26'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		1'897	14'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		10'912	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		9'856	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		8'506	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		6'000	5'562		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		7'000	7'046		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		40'755	59'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		438'494	440'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		581'617	635'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		430'208	60'850'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		10'036	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		64'088	99'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		104'370	92'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		150'844	1'111'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		5'440	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		4'467	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		6'000	5'559		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		15'000	13'932		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		13'094	1'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		1'500	1'698		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		8'000	5'526		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		5'363	40'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		2'000	1'298		AUD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		1'000	1'152	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		500'000	3'492	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		2'000	2'284	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		4'000	4'004	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		5'000	703	CNY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		104'074	92'000	CHF/GBP		5.62	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		578'976	620'000	CHF/USD		7.87	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		428'735	62'250'000	CHF/JPY		-74.18	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		61'275	97'185	CHF/AUD		-3.98	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		35'239	51'360	CHF/CAD		-0.72	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		9'807	16'950	CHF/NZD		-0.42	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		154'249	1'146'000	CHF/CNY		-76.49	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		432'639	436'000	CHF/EUR		-6.35	0.00	b)
<b>Klasse A hedged</b>							<b>-148.65</b>	<b>0.00</b>	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		35'969	53'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		33'793	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		112'664	798'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		485'971	499'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.10.2022		7'216	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		307'641	43'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		336'931	343'500	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		72'507	64'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		5'000	4'920	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		400'000	2'844	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		4'000	4'561	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		3'000	2'976	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		3'855	4'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		3'361	3'500	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		3'808	4'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		4'021	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		5'000	4'820	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		10'000	9'834	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		7'000	6'698	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		3'000	3'238	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		350'000	2'423	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		3'000	3'227	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		5'000	4'932	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		6'000	5'700	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		2'000	2'138	GBP/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		4'438	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'465	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		32'904	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		6'756	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		59'554	54'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		319'225	329'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		34'191	53'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		292'184	42'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		6'000	5'970	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		479'665	484'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		111'054	798'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		5'000	4'992	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		7'000	6'786	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		4'000	4'413	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		4'955	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		7'000	7'049	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		3'000	1'901	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		8'000	1'143	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		300'000	2'074	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		9'907	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		6'000	6'030	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		5'632	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		6'000	6'003	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		700'000	4'747	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		5'892	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		32'493	50'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		63'216	55'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		33'278	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		107'683	790'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		474'306	475'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		7'015	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		318'126	322'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		281'114	41'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		4'683	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		3'913	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		6'000	6'094		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		5'000	4'970		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		4'906	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		3'925	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		6'000	5'923		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		500'000	3'394		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		4'797	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		9'412	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		4'850	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		5'412	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		4'420	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		5'865	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		4'754	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		106'035	790'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		463'159	488'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		66'712	59'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		329'028	336'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		32'371	50'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		7'129	12'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		31'842	45'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		291'837	42'750'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		10'000	9'512		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'885		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		1'000'000	6'858		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		5'593	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		7'435	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		4'901	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		9'000	8'341		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'921		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		500'000	3'457		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.01.2023		10'000	1'359		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		9'231	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		4'910	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		12'121	1'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		9'028	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		3'086	5'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		2'224	17'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'938		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		8'000	7'450		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'929		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		6'000	5'659		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		6'000	5'972		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		700'000	5'053		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		2'000	1'406		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		3'000	1'928		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		444'434	479'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		298'331	42'350'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		107'212	797'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		307'197	312'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		7'079	12'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		74'840	67'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		33'639	52'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		29'810	43'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		5'531	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'893	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		7'301	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		3'913	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		4'846	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		8'000	7'463		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		5'000	5'036		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		800'000	5'650		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		29'000	26'923		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		8'559	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		11'552	18'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		1'209	9'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		7'265	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		6'890	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		4'950	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		5'000	4'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		4'000	4'039		EUR/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		7'165	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		312'140	44'150'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		317'908	319'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		420'871	459'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		109'433	806'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		75'597	67'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		29'866	43'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		45'812	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		4'528	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		3'343	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		5'000	4'637	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		10'000	9'298	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		8'950	1'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		1'500	1'698	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		6'000	4'152	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		4'015	30'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		300'000	2'107	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		3'000	3'010	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		2'000	2'284	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		6'000	838	CNY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		313'564	316'000	CHF/EUR		-4.60	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		310'962	45'150'000	CHF/JPY		-53.79	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		419'757	449'500	CHF/USD		5.71	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		44'702	70'900	CHF/AUD		-2.91	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		111'716	830'000	CHF/CNY		-55.40	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		25'729	37'500	CHF/CAD		-0.53	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		7'001	12'100	CHF/NZD		-0.31	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		75'228	66'500	CHF/GBP		4.07	0.00	b)
<b>Klasse B hedged</b>							<b>-107.76</b>	<b>0.00</b>	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		1'404'616	1'432'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		306'454	270'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		2'034'365	2'091'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		1'281'957	182'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.10.2022		30'115	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		140'462	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		147'415	220'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		469'433	3'325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		9'000	10'226	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		20'000	19'591	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'657	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		5'000	5'694	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		25'000	24'582	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		24'249	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		19'345	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		13'474	2'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		14'361	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'400	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	49'052	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		35'000	33'369	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		15'000	16'070	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'501	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		12'000	12'817	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'737	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		16'000	15'150	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		11'000	11'622	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		2'000'000	13'746	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		16'726	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'743	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		1'200'000	8'182	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		140'128	220'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		1'225'464	179'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		462'724	3'325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		1'339'970	1'381'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		1'990'930	2'011'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		248'693	225'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		28'195	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		10'000	9'733	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		136'768	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		30'000	29'954	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		25'000	24'237	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		6'000	6'620	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		9'940	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		5'000	3'157	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		20'000	20'084	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		2'000'000	13'658	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		22'000	3'090	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		39'720	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		20'000	20'031	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		25'000	24'916	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		2'000'000	13'506	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		13'662	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		24'647	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		266'080	231'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		29'278	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		450'225	3'303'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		1'180'344	175'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		137'823	215'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		138'322	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		1'985'999	1'991'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		1'329'805	1'346'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		13'437	2'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'755	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		15'000	14'849	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		30'000	30'348	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		24'648	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		30'000	29'496	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		3'000'000	20'214	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		17'349	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'733	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		42'457	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		24'372	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		27'180	4'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		16'656	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		19'016	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'663	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		137'307	215'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		132'353	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		1'933'227	2'039'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		278'722	246'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		1'217'183	178'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		29'754	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		443'332	3'303'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		1'371'929	1'401'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		20'000	19'616	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		3'000'000	20'513	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		30'000	28'476	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'713	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'632	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		30'000	27'733	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		12'000	11'844	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		1'500'000	10'311	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.01.2023		40'000	5'347	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		46'274	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		19'731	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		45'262	40'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		47'222	7'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		11'811	19'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		8'855	67'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		20'000	19'767	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		30'000	27'754	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		25'000	24'646	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		40'000	37'556	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		5'000'000	35'909	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		8'000	5'534	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		45'000	44'597	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		11'000	6'989	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		1'238'409	175'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		1'279'002	1'299'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'852'813	1'999'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		124'122	181'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		447'952	3'330'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		142'378	223'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		320'025	286'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		29'546	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		23'142	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		22'616	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		32'042	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		14'758	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		27'833	4'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		2'500'000	17'593		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		25'000	23'257		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		125'000	115'949		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		15'000	15'079		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		25'022	3'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		49'514	77'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		5'339	39'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		29'627	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		31'884	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		24'868	3'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		15'000	13'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		12'000	12'058		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		194'427	300'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		124'355	181'125		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		1'302'997	184'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'335'415	1'340'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		1'766'833	1'929'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		29'902	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		457'419	3'369'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		323'264	286'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		13'644	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		7'840	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		20'000	18'458		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		10'000	9'906		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		40'000	37'103		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		41'415	6'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		5'000	5'591		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		17'497	130'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		25'000	17'204		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		5'000	3'200		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		1'200'000	8'338		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		4'000	4'519		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		5'000	5'664		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		20'000	2'722		CNY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		316'182	279'500		CHF/GBP	17.09	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		1'319'747	1'330'000		CHF/EUR	-19.38	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'759'339	1'884'000		CHF/USD	23.94	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		468'266	3'479'000		CHF/CNY	-232.21	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		29'219	50'500		CHF/NZD	-1.27	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		107'119	156'125		CHF/CAD	-2.16	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		186'563	295'900		CHF/AUD	-12.14	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'302'390	189'100'000		CHF/JPY	-225.32	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		15'000	14'915		EUR/CHF	-30.04	0.00	b)
<b>Klasse It hedged</b>							<b>-481.49</b>	<b>0.00</b>	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		44'629'904	45'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		40'859'289	5'804'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		14'993'635	106'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		4'545'293	6'120'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		9'867'698	8'710'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		64'737'764	66'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.10.2022		954'392	1'600'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		4'766'788	7'143'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		360'000	407'939		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		350'000	342'395		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		20'000'000	140'714		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		130'000	147'294		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		400'000	392'912		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		485'491	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		435'860	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		479'619	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		405'024	60'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		600'000	578'044		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		1'300'000	1'274'828		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		900'000	857'446		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		600'000	641'738		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		250'000	266'454		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		400'000	392'279		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		450'000	425'343		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		300'000	316'219		GBP/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		446'730	400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		70'000'000	480'151		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		500'000	490'528		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		40'000'000	271'782		JPY/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		893'521	1'600'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		4'531'162	7'143'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		14'779'323	106'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		4'425'739	6'120'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		42'935'333	44'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		63'697'887	64'340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		7'962'577	7'220'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		300'000	291'152		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		39'190'227	5'734'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		1'000'000	998'454		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		900'000	872'529		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		200'000	220'668		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		398'700	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		180'000	112'603		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		500'000	501'461		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		60'000'000	408'919		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		160'000	115'619		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		110'000	68'633		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		550'000	76'534		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2022		60'000	33'541		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		1'192'250	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		1'000'000	1'000'256		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		600'000	597'390		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		60'000'000	404'364		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		456'321	400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		789'505	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		37'800'634	5'614'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		8'528'363	7'420'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		42'532'022	43'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		14'400'940	105'650'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		4'374'729	6'853'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		4'359'025	5'960'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		63'480'136	63'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		893'064	1'540'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		471'239	70'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		493'884	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		800'000	808'632		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		400'000	395'250		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		50'000'000	337'917		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		392'796	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		345'121	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		723'968	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		688'814	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		1'415'963	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		634'325	650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		1'020'150	150'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		556'105	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		472'327	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		4'358'337	6'853'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		4'170'927	5'960'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		907'596	1'540'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		14'180'449	105'650'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		62'566'769	65'990'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		43'919'363	44'850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		39'485'054	5'784'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		8'955'302	7'920'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		900'000	853'551		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		120'000'000	819'468		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		374'784	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		559'740	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		225'852	1'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		1'388'832	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		592'698	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		1'687'238	250'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		1'698'105	1'500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		498'482	800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		198'885	1'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		700'000	690'927		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		400'000	393'931		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		1'500'000	1'407'515		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		1'300'000	1'287'738		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		70'000'000	502'416		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		260'000	164'529		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		61'256'838	66'090'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		42'387'245	43'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		4'084'281	5'960'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		4'701'223	7'393'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		10'522'291	9'420'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		14'642'502	108'850'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		901'240	1'540'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		41'167'590	5'844'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		648'676	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		590'643	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		916'168	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		394'254	400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		626'790	90'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		600'000	557'553		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		90'000'000	632'394		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		4'400'000	4'081'185		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		1'001'868	140'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		1'608'263	2'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		284'898	2'070'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'093'980	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		741'270	750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		711'234	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		500'000	461'106		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		700'000	701'758		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		6'392'362	9'893'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		43'013'758	6'084'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		4'091'957	5'960'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		912'086	1'540'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		58'152'523	63'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		43'949'090	44'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		10'628'774	9'420'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		15'059'941	110'920'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		820'290	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		337'208	300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		500'000	460'799		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		4'000'000	3'708'060		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		1'700'000	1'681'390		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		11'000'000	76'014		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		530'000	589'601		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		960'000	659'606		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		220'000	139'822		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		20'000'000	138'197		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		230'000	145'837		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		100'998	750'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		180'000	202'882		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		15'030'559	111'670'000		CHF/CNY	-7'453.67	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		55'927'198	59'890'000		CHF/USD	760.95	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		42'073'138	42'400'000		CHF/EUR	-617.91	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		3'430'555	5'000'000		CHF/CAD	-69.50	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		10'192'481	9'010'000		CHF/GBP	551.01	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		41'688'887	6'053'000'000		CHF/JPY	-7'212.40	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		891'252	1'540'400		CHF/NZD	-38.70	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		5'953'764	9'443'000		CHF/AUD	-387.47	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		400'000	397'004		EUR/CHF	-81.70	0.00	b)
	<b>Klasse Nt hedged</b>						<b>-14'549.39</b>	<b>-0.01</b>	
	<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>						<b>-15'287.29</b>	<b>-0.01</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'712'709.95	0.65
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	258'928'926.29	98.53
Derivative Finanzinstrumente	-15'287.29	-0.01
Sonstige Vermögenswerte	2'161'624.60	0.82

<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>262'787'973.55</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-9'654.32	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>262'778'319.23</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % )</b>
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	258'928'926.29	98.53
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-15'287.29	-0.01
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.63203454
CAD	1 = CHF	0.68842043
CNY	1 = CHF	0.13482314
EUR	1 = CHF	0.99395514
GBP	1 = CHF	1.13468171
JPY	100 = CHF	0.68806700
NZD	1 = CHF	0.58067324
USD	1 = CHF	0.93725000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

<b>Engagement</b>	<b>Währung</b>	<b>Betrag</b>	<b>in % (28)</b>
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	412'491.39	0.157
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	184'126'603.32	70.069

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2022 - 28.02.2023

<b>Klasse</b>	<b>Währung</b>	<b>Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)</b>		<b>Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)</b>	
		<b>Teilvermögen</b>	<b>Fondsleitung</b>	<b>Teilvermögen</b>	<b>Fondsleitung</b>
A	CHF	0.15	-	0.10	-
A hedged	CHF	0.15	-	0.10	-
B	CHF	0.15	-	0.10	-
B hedged	CHF	0.15	-	0.10	-
It	CHF	0.15	-	0.10	-
It hedged	CHF	0.15	-	0.10	-
Nt	CHF	0.15	-	0.10	-
Nt hedged	CHF	0.15	-	0.10	-
Pt	CHF	0.15	-	0.10	-
Pt hedged	CHF	0.15	-	0.10	-
St	CHF	0.15	-	0.10	-
St hedged	CHF	0.15	-	0.10	-

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.09.2022 - 28.02.2023

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % Max
A	0.800	1.000	-
A hedged	0.850	1.000	-
B	0.800	1.000	-
B hedged	0.850	1.000	-
It	0.230	0.400	-
It hedged	0.280	0.500	-
Nt	0.030	0.200	-
Nt hedged	0.030	0.200	-

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

## 8 Benchmark

Barclays Global Aggregate Treasury AAA-BBB

## 9 TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt.

## 10 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

## 11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.

Er wird auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Der Besondere Teil kann für einzelne Rechnungseinheiten bzw. Referenzwährungen abweichende Rundungsbestimmungen vorsehen.

7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse

bestimmt.

Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

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