

# BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL UNTERNEHMENSANLEIHEN

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	30461403	CHF
A hedged	30509115	CHF
B	30528085	CHF
B hedged	30528075	CHF
It	29117679	CHF
It hedged	29117711	CHF
Nt	29117780	CHF
Nt hedged	29117785	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	22
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	23
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	23
7	Verwaltungskommission	24
8	Benchmark	24
9	TER	24
10	Fussnoten	25
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	26

# 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		218'822'370.25	238'327'186.88	315'060'973.10	349'123'578.69
<b>Klasse A</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'906'280.98	16'592'397.12	21'865'916.63	24'572'455.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		196'669.000	204'241.000	224'584.000	253'177.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		75.79	81.24	97.36	97.06
Ausschüttung je Anteil		-	1.95	2.00	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
<b>Klasse A hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'963'704.71	28'736'778.31	41'562'184.33	46'482'147.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		352'814.818	368'122.818	431'485.627	472'045.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.59	78.06	96.32	98.47
Ausschüttung je Anteil		-	1.90	1.80	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
<b>Klasse B</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'200'092.80	7'840'057.52	10'402'760.86	10'560'422.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		86'120.613	88'967.000	99'898.252	103'093.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.60	88.12	104.13	102.44
Thesaurierung je Anteil		-	2.04	2.03	2.17
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
<b>Klasse B hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'286'259.19	10'397'685.27	18'565'109.56	19'385'295.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		114'472.000	122'838.000	179'947.000	186'315.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.12	84.65	103.17	104.05
Thesaurierung je Anteil		-	1.96	1.98	2.05
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
<b>Klasse It</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'522'235.37	3'394'278.18	4'346'122.13	3'068'723.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		39'957.679	36'553.534	39'755.534	28'641.855
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		88.15	92.86	109.32	107.14
Thesaurierung je Anteil		-	2.72	2.74	2.88
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
<b>Klasse It hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'853'853.58	6'106'350.10	7'997'325.24	7'371'627.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		69'846.000	69'846.000	75'276.000	68'999.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.81	87.43	106.24	106.84
Thesaurierung je Anteil		-	2.57	2.64	2.69
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %
<b>Klasse Nt</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		33'798'371.51	35'450'023.58	42'174'095.80	34'891'197.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		368'082.092	366'609.917	371'192.076	313'953.093
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		91.82	96.70	113.62	111.14
Thesaurierung je Anteil		-	3.14	3.18	3.32
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

Klasse Nt hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		118'291'572.11	129'809'616.80	168'147'458.55	202'791'709.90
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'392'005.854	1'465'545.213	1'567'074.702	1'885'373.849
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.98	88.57	107.30	107.56
Thesaurierung je Anteil		-	2.94	3.03	3.08
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	-11.57 %	-17.60 %	-1.38 %	-0.06 %
Klasse A hedged	-13.73 %	-18.87 %	-3.38 %	5.06 %
Klasse B	-11.56 %	-17.59 %	-1.38 %	-0.07 %
Klasse B hedged	-13.76 %	-18.87 %	-3.39 %	5.03 %
Klasse It	-11.05 %	-17.13 %	-0.82 %	0.51 %
Klasse It hedged	-13.32 %	-18.49 %	-2.86 %	5.54 %
Klasse Nt	-10.79 %	-16.87 %	-0.52 %	0.81 %
Klasse Nt hedged	-12.94 %	-18.12 %	-2.48 %	5.97 %
Benchmark Hedge	-12.44 %	-16.79 %	-	-
Benchmark	-10.17 %	-15.68 %	-0.23 %	0.44 %
Tracking Error 33)	-	0.99 %	0.31 %	0.84 %

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	-1.40 %
Klasse A hedged	-1.29 %
Klasse B	-1.39 %
Klasse B hedged	-1.32 %
Klasse It	-0.88 %
Klasse It hedged	-0.88 %
Klasse Nt	-0.62 %
Klasse Nt hedged	-0.50 %

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	1'045'888.94	1'431'369.90
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	215'328'981.95	234'619'442.86
Derivative Finanzinstrumente	748.63	20'787.07
Sonstige Vermögenswerte	2'494'512.21	2'317'857.31
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>218'870'131.73</b>	<b>238'389'457.14</b>
Andere Verbindlichkeiten	-47'761.48	-62'270.26
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>218'822'370.25</b>	<b>238'327'186.88</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		204'241.000	224'584.000
Ausgegebene Anteile		2'495.000	375.000
Zurückgenommene Anteile		-10'067.000	-20'718.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>196'669.000</b>	<b>204'241.000</b>
<b>Klasse A hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		368'122.818	431'485.627
Ausgegebene Anteile		3'335.000	2'812.889
Zurückgenommene Anteile		-18'643.000	-66'175.698
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>352'814.818</b>	<b>368'122.818</b>
<b>Klasse B</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		88'967.000	99'898.252
Ausgegebene Anteile		1'523.613	2'328.748
Zurückgenommene Anteile		-4'370.000	-13'260.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>86'120.613</b>	<b>88'967.000</b>
<b>Klasse B hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		122'838.000	179'947.000
Zurückgenommene Anteile		-8'366.000	-57'109.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>114'472.000</b>	<b>122'838.000</b>
<b>Klasse It</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		36'553.534	39'755.534
Ausgegebene Anteile		3'404.145	-
Zurückgenommene Anteile		-	-3'202.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>39'957.679</b>	<b>36'553.534</b>
<b>Klasse It hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		69'846.000	75'276.000
Ausgegebene Anteile		-	2'000.000
Zurückgenommene Anteile		-	-7'430.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>69'846.000</b>	<b>69'846.000</b>
<b>Klasse Nt</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		366'609.917	371'192.076
Ausgegebene Anteile		5'954.652	32'222.188
Zurückgenommene Anteile		-4'482.477	-36'804.347
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>368'082.092</b>	<b>366'609.917</b>
<b>Klasse Nt hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'465'545.213	1'567'074.702
Ausgegebene Anteile		100'749.287	244'241.661
Zurückgenommene Anteile		-110'288.646	-345'771.150
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-64'000.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'392'005.854</b>	<b>1'465'545.213</b>

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse Nt hedged	22.02.2023	5'454'080.00	64'000.000

## Veränderung des Nettofondsvermögens

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.09.2022 28.02.2023</b>	<b>01.09.2021 31.08.2022</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		238'327'186.88	315'060'973.10
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'073'818.40	-1'176'255.53
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'154'191.93	-2'352'323.54
Saldo aus dem Anteilverkehr		-8'377'757.26	-23'971'802.77
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-7'899'049.04	-49'233'404.38
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>218'822'370.25</b>	<b>238'327'186.88</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		5'470.20	0.74
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-230.25	-13'629.85
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'351'101.06	8'431'715.65
Sonstige Erträge		0.00	-0.02
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		72'358.23	557'542.25
<b>Total Ertrag</b>		<b>3'428'699.24</b>	<b>8'975'628.77</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-3'127.04
Reglementarische Vergütungen		-314'753.59	-814'023.66
Sonstige Aufwendungen		0.00	-379.45
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-175'162.66	-933'536.34
<b>Total Aufwand</b>		<b>-489'916.25</b>	<b>-1'751'066.49</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>2'938'782.99</b>	<b>7'224'562.28</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-4'907'670.52	-16'605'448.81
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		34'626.15	116'962.39
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-1'934'261.38</b>	<b>-9'263'924.14</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'964'787.66	-39'969'480.24
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-7'899'049.04</b>	<b>-49'233'404.38</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>215'328'981.95</b>	<b>98.38</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>215'328'981.95</b>	<b>98.38</b>	
AU000XCLWA18	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	2'000	0	0	2'000 AUD	101.91%	1'288'162.24	0.59	a)
US89400PAE34	4.1250 % TCLAU 4 1/8 02/02/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	95.64%	2'689'157.70	1.23	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	95.88%	1'797'326.84	0.82	a)
<b>AU</b>							<b>5'774'646.78</b>	<b>2.64</b>	
CA06368BTX69	3.1900 % BMO 3.19 03/01/28 DPNT	2'000	0	60	1'940 CAD	93.86%	1'253'587.17	0.57	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	1'400	0	0	1'400 CAD	96.38%	928'880.18	0.42	a)
CA628153AA60	3.6300 % CANMFA 3.63 06/01/29 A	2'100	0	0	2'100 CAD	99.03%	1'431'601.95	0.65	a)
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	2'000	0	60	1'940 CAD	97.82%	1'306'461.02	0.60	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	2'000	0	0	2'000 USD	116.45%	2'182'780.27	1.00	a)
X51945965611	0.8750 % CPPIBC 0 7/8 02/06/29 EMTN	800	0	0	800 EUR	85.98%	683'682.10	0.31	a)
X52163020790	1.1250 % CPPIBC 1 1/8 12/14/29 EMTN	1'600	0	0	1'600 GBP	80.60%	1'463'358.15	0.67	a)
<b>CA</b>							<b>9'250'350.84</b>	<b>4.23</b>	
CH0591979627	0.6250 % CS 0 5/8 01/18/33 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	300	1'000	0	1'300 EUR	88.78%	1'147'202.15	0.52	a)
US225401AC20	4.2820 % CS 4.282 01/09/28 144A	5'000	0	0	5'000 USD	83.74%	3'924'265.75	1.79	a)
USH3698DDR29	6.3730 % CS 6.373 07/15/26 REGS	1'500	0	250	1'250 USD	94.14%	1'102'850.36	0.50	a)
<b>CH</b>							<b>6'174'318.26</b>	<b>2.82</b>	
X51084942470	2.2500 % CDEL 2 1/4 07/09/24 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	97.46%	1'937'337.84	0.89	a)
X51346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	2'000	0	0	2'000 EUR	93.62%	1'861'141.24	0.85	a)
X52388560604	0.5550 % CHILE 0.555 01/21/29	2'000	0	0	2'000 EUR	81.06%	1'611'340.44	0.74	a)
<b>CL</b>							<b>5'409'819.52</b>	<b>2.47</b>	
US251526CC16	2.2220 % DB 2.222 09/18/24	2'000	0	0	2'000 USD	97.80%	1'833'279.75	0.84	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	7'000	0	0	7'000 JPY	105.45%	50'790.15	0.02	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	6'000	0	0	6'000 JPY	123.11%	50'824.34	0.02	a)
X52035038731	1.8750 % NRWK 1 7/8 07/31/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	84.82%	1'192'477.23	0.54	a)
X52484327999	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 05/24/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.52%	177'957.73	0.08	a)
<b>DE</b>							<b>3'305'329.20</b>	<b>1.51</b>	
X52046595836	0.5000 % DANBNK 0 1/2 08/27/25	2'500	0	0	2'500 EUR	94.15%	2'339'397.67	1.07	a)
X52100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	700	0	0	700 GBP	86.92%	690'346.03	0.32	a)
<b>DK</b>							<b>3'029'743.70</b>	<b>1.38</b>	
JP572405AHC4	0.5680 % SANTAN 0.568 01/11/23 1	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAF29	3.8000 % SANTAN 3.8 02/23/28	3'000	0	1'000	2'000 USD	91.75%	1'719'891.24	0.79	a)
X51201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	96.58%	959'961.87	0.44	a)
X52058729653	0.3750 % BBVASM 0 3/8 10/02/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>ES</b>							<b>2'679'853.11</b>	<b>1.22</b>	
X52185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	800	0	150	650 EUR	91.73%	592'660.16	0.27	a)
<b>FI</b>							<b>592'660.16</b>	<b>0.27</b>	
AU3CB0252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	2'000	0	0	2'000 AUD	90.21%	1'140'278.79	0.52	a)
FR0013248523	1.5000 % VIEFP 1 1/2 04/03/29 EMTN	1'500	0	100	1'400 EUR	87.39%	1'216'036.52	0.56	a)
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	800	0	200	600 EUR	85.38%	509'183.34	0.23	a)
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	700	400	0	1'100 GBP	87.85%	1'096'474.71	0.50	a)
FR0013515749	1.2500 % BFCM 1 1/4 06/03/30	0	900	0	900 EUR	80.66%	721'578.63	0.33	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	800	0	0	800 EUR	78.11%	621'094.74	0.28	a)
FR0013532280	0.5000 % BNP 0 1/2 09/01/28	2'000	0	0	2'000 EUR	83.68%	1'663'523.08	0.76	a)
FR0014000717	0.6250 % BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN	0	900	0	900 EUR	75.06%	671'447.51	0.31	a)
FR0014001EW8	0.0000 % ALOFP 0 01/11/29	1'000	0	500	500 EUR	79.58%	395'469.90	0.18	a)
FR001400EHG3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 12/06/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.80%	962'168.45	0.44	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.
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	0	100'000	0	100'000 JPY	99.05%	681'537.24	0.31	a)
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	0	1'000	0	1'000 USD	95.15%	891'784.00	0.41	a)
USF1R15XK516	4.3750 % BNP 4 3/8 05/12/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	96.53%	1'809'454.85	0.83	a)
USF43628C650	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 08/19/26 REGS	500	0	0	500 USD	94.44%	442'583.51	0.20	a)
XS0878743623	5.1250 % AXASA 5 1/8 07/04/43 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	100.15%	3'981'903.57	1.82	a)
<b>FR</b>							<b>16'804'518.84</b>	<b>7.68</b>	
JP582667AJ57	0.6500 % LLOYDS 0.65 05/30/23 6	100'000	0	0	100'000 JPY	99.91%	687'420.22	0.31	a)
US06738EAP07	5.2000 % BACR 5.2 05/12/26	2'000	0	0	2'000 USD	97.36%	1'824'919.48	0.83	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	2'000	0	0	2'000 USD	120.86%	2'265'501.96	1.04	a)
US111021AM38	4.5000 % BRITEL 4 1/2 12/04/23	600	0	0	600 USD	99.24%	558'081.76	0.25	a)
US53944YAB92	4.6500 % LLOYDS 4.65 03/24/26	2'000	0	0	2'000 USD	96.38%	1'806'718.08	0.83	a)
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	1'000	500	0	1'500 USD	78.64%	1'105'594.16	0.51	a)
US92857WAB63	6.2500 % VOD 6 1/4 11/30/32	100	0	0	100 USD	105.86%	99'218.22	0.05	a)
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	200	0	0	200 USD	92.02%	172'495.24	0.08	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	2'000	0	0	2'000 USD	96.92%	1'816'709.17	0.83	a)
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	0	900	0	900 USD	100.99%	851'850.59	0.39	a)
X50097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	100	0	0	100 GBP	101.78%	115'483.37	0.05	a)
X50158715713	5.9000 % VOD 5.9 11/26/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.99%	119'133.64	0.05	a)
X50159497162	5.7500 % HSBC 5 3/4 12/20/27 EMTN	600	0	600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50753789980	4.3750 % CNALN 4 3/8 03/13/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	93.44%	1'060'223.90	0.48	a)
X51083226321	4.7500 % MRWLN 4 3/4 07/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	78.30%	888'410.39	0.41	a)
X51171485722	1.1250 % WELTR 1 1/8 01/21/27	300	0	0	300 EUR	90.95%	271'206.62	0.12	a)
X51345415472	3.6250 % SANUK 3 5/8 01/14/26 EMTN	200	0	0	200 GBP	94.57%	214'602.35	0.10	a)
X51480699641	4.3000 % STANLN 4.3 02/19/27 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51550975079	3.1250 % BACR 3 1/8 01/17/24 EMTN	200	0	0	200 GBP	98.08%	222'570.09	0.10	a)
X51637333748	1.5000 % BRITEL 1 1/2 06/23/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.27%	89'721.35	0.04	a)
X52044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	100	0	0	100 GBP	89.15%	101'161.41	0.05	a)
<b>GB</b>							<b>14'271'022.00</b>	<b>6.52</b>	
X51108784510	4.5000 % SRENVX 4 1/2 09/11/44	2'000	0	0	2'000 USD	96.04%	1'800'251.06	0.82	a)
X51385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	98.18%	920'220.17	0.42	a)
X51843437036	2.2000 % RURAIL 2.2 05/23/27	3'000	0	0	3'000 EUR	30.00%	894'559.63	0.41	c)
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	78.05%	1'024'106.83	0.47	a)
<b>IE</b>							<b>4'639'137.69</b>	<b>2.12</b>	
X50986194883	4.0000 % ISPIM 4 10/30/23 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.30%	99'697.68	0.05	a)
X51785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.69%	87'160.92	0.04	a)
X52265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	700	0	0	700 EUR	85.41%	594'255.96	0.27	a)
X52348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	87.37%	1'637'731.91	0.75	a)
<b>IT</b>							<b>2'418'846.47</b>	<b>1.11</b>	
US90351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	3'250	0	250	3'000 USD	96.23%	2'705'606.44	1.24	a)
X52242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	2'000	0	0	2'000 EUR	93.14%	1'851'460.12	0.85	a)
<b>JE</b>							<b>4'557'066.56</b>	<b>2.08</b>	
US86562MCS70	5.7660 % SUMIBK 5.766 01/13/33	0	1'000	0	1'000 USD	100.96%	946'219.48	0.43	a)
USJ57160DY66	4.3450 % NSANY 4.345 09/17/27 REGS	900	0	0	900 USD	91.24%	769'632.21	0.35	a)
X52328980979	0.0100 % ASABRE 0.01 04/19/24	0	600	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52489982293	3.5560 % MUFG 3.556 06/15/32 EMTN	0	900	0	900 EUR	94.33%	843'838.10	0.39	a)
<b>JP</b>							<b>2'559'689.79</b>	<b>1.17</b>	
US50064FAL85	4.1250 % KOREA 4 1/8 06/10/44	2'000	0	0	2'000 USD	93.27%	1'748'346.15	0.80	a)
<b>KR</b>							<b>1'748'346.15</b>	<b>0.80</b>	
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	1'400	0	0	1'400 EUR	52.53%	730'918.83	0.33	a)
X51637162592	1.2000 % DHR 1.2 06/30/27	2'500	0	200	2'300 EUR	89.85%	2'054'012.27	0.94	a)
X51960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	1'000	0	200	800 EUR	76.78%	610'558.81	0.28	a)
X52286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	69.10%	1'236'209.84	0.56	a)
X52318745937	1.2620 % ISDB 1.262 03/31/26	4'000	0	0	4'000 USD	89.52%	3'355'992.33	1.53	a)
X52397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	61.20%	912'421.00	0.42	a)
<b>LU</b>							<b>8'900'113.08</b>	<b>4.07</b>	
X51974394675	1.6250 % MEX 1 5/8 04/08/26	100	0	0	100 EUR	93.57%	92'999.41	0.04	a)
<b>MX</b>							<b>92'999.41</b>	<b>0.04</b>	

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.
DE000A1954U8	0.2500 % ALVGR 0 1/4 06/06/23 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A28RSQ8	0.0000 % ALVGR 0 01/14/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	0	700	0	700 USD	118.58%	777'999.98	0.36	a)
US25156PBB85	4.3750 % DT 4 3/8 06/21/28 144A	1'900	0	1'400	500 USD	96.18%	450'728.21	0.21	a)
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	100	0	0	100 USD	89.78%	84'146.31	0.04	a)
US780641AH94	8.3750 % KPN 8 3/8 10/01/30	3'000	0	1'300	1'700 USD	116.70%	1'859'394.34	0.85	a)
US826200AD92	6.1250 % SIEGR 6 1/8 08/17/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	103.67%	971'656.45	0.44	a)
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	1'700	0	0	1'700 USD	94.23%	1'501'453.88	0.69	a)
XS0148579666	6.3750 % EOANGR 6 3/8 06/07/32 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	106.89%	1'819'325.96	0.83	a)
XS1116408235	1.8750 % IBESM 1 7/8 10/08/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	2'000	0	0	2'000 USD	96.78%	1'814'178.59	0.83	a)
XS1405780963	1.3750 % ASML 1 3/8 07/07/26	2'000	0	0	2'000 EUR	93.22%	1'853'090.20	0.85	a)
XS170553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	92.77%	922'102.12	0.42	a)
XS1901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	80.58%	800'899.23	0.37	a)
XS1910948675	4.1250 % VW 4 1/8 11/16/38	0	700	0	700 EUR	92.34%	642'500.55	0.29	a)
XS2191362859	1.2500 % DLR 1 1/4 02/01/31	0	1'000	0	1'000 EUR	75.96%	755'048.08	0.34	a)
XS2258452478	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/18/29	1'500	0	0	1'500 EUR	80.85%	1'205'344.55	0.55	a)
<b>NL</b>							<b>15'457'868.45</b>	<b>7.06</b>	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	1'000	0	0	1'000 USD	123.90%	1'161'280.87	0.53	a)
<b>PE</b>							<b>1'161'280.87</b>	<b>0.53</b>	
US86960BAX01	3.9000 % SHBASS 3.9 11/20/23 BKNT	0	600	0	600 USD	98.86%	555'911.09	0.25	a)
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	0	800	0	800 USD	95.37%	715'084.26	0.33	a)
XS2343459074	0.6250 % NDASS 0 5/8 08/18/31 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	86.83%	1'380'850.19	0.63	a)
<b>SE</b>							<b>2'651'845.54</b>	<b>1.21</b>	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	800	0	0	800 USD	94.70%	710'045.60	0.32	a)
XS2080786150	1.2500 % TEMASE 1 1/4 11/20/49 GMTN	620	0	0	620 EUR	61.99%	382'039.38	0.17	a)
<b>SG</b>							<b>1'092'084.98</b>	<b>0.50</b>	
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BT22	2.5000 % AMZN 2 1/2 06/03/50	2'000	0	0	2'000 USD	64.04%	1'200'392.31	0.55	a)
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	0	1'000	0	1'000 USD	83.97%	787'008.83	0.36	a)
US02665WDW82	2.0000 % HNDA 2 03/24/28 MTN	2'000	0	1'000	1'000 USD	86.50%	810'749.37	0.37	a)
US026874DA29	4.5000 % AIG 4 1/2 07/16/44	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAZ33	2.4000 % AMT 2.4 03/15/25	100	0	0	100 USD	93.86%	87'966.54	0.04	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	100	0	0	100 USD	84.60%	79'289.48	0.04	a)
US03522AAJ97	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	0	1'500	0	1'500 USD	91.80%	1'290'649.49	0.59	a)
US035240AG57	4.9500 % ABIBB 4.95 01/15/42	100	0	0	100 USD	93.37%	87'511.97	0.04	a)
US036752AC75	3.3500 % ELV 3.35 12/01/24	0	1'000	0	1'000 USD	96.72%	906'508.20	0.41	a)
US036752AG89	4.1010 % ELV 4.101 03/01/28	100	500	0	600 USD	95.40%	536'481.90	0.25	a)
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	1'000	0	0	1'000 USD	85.94%	805'425.79	0.37	a)
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	900	0	0	900 USD	84.44%	712'238.77	0.33	a)
US037833DZ01	2.4000 % AAPL 2.4 08/20/50	2'000	0	0	2'000 USD	63.39%	1'188'320.53	0.54	a)
US037833EA41	2.5500 % AAPL 2.55 08/20/60	2'000	0	0	2'000 USD	62.28%	1'167'494.84	0.53	a)
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	0	1'000	350	650 USD	63.80%	388'653.21	0.18	a)
US04686E2U56	2.5500 % ATH 2.55 11/19/30 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565EBE41	3.9500 % BMW 3.95 08/14/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	94.43%	885'054.55	0.40	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	2'000	0	200	1'800 USD	91.27%	1'539'787.41	0.70	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	2'000	0	1'000	1'000 USD	83.86%	785'949.73	0.36	a)
US07177MAB90	4.0000 % TACHEM 4 06/23/25	0	1'000	0	1'000 USD	96.96%	908'785.72	0.42	a)
US07274NAE31	3.8750 % BAYNGR 3 7/8 12/15/23 144A	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US08652BAB53	1.9500 % BBY 1.95 10/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	78.61%	1'473'450.73	0.67	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	500	0	0	500 USD	81.00%	379'576.88	0.17	a)
US110122DX32	3.9000 % BMY 3.9 03/15/62	0	1'000	0	1'000 USD	78.30%	733'857.38	0.34	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	100	0	0	100 USD	69.73%	65'353.51	0.03	a)
US125523CB40	3.4000 % CI 3.4 03/01/27	1'940	0	1'940	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126408GK35	6.1500 % CSX 6.15 05/01/37	1'000	0	200	800 USD	105.46%	790'724.08	0.36	a)
US161175CA05	3.9000 % CHTR 3.9 06/01/52	160	0	0	160 USD	63.02%	94'503.29	0.04	a)
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	1'800	0	0	1'800 USD	95.57%	1'612'347.43	0.74	a)
US177376AE06	4.5000 % CTXS 4 1/2 12/01/27	900	0	0	900 USD	73.54%	620'294.54	0.28	a)
US20030NBQ34	4.6000 % CMCSA 4.6 08/15/45	2'000	0	350	1'650 USD	88.21%	1'364'119.11	0.62	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.
US24703TAB26	4.0000 % DELL 4 07/15/24	1'500	0	0	1'500 USD	97.99%	1'377'673.15	0.63	a)
US260543BJ10	7.3750 % DOW 7 3/8 11/01/29	2'000	0	0	2'000 USD	111.00%	2'080'751.24	0.95	a)
US26078JAD28	4.7250 % DD 4.725 11/15/28	100	0	0	100 USD	98.30%	92'134.49	0.04	a)
US278642AX15	1.4000 % EBAY 1.4 05/10/26	3'000	0	0	3'000 USD	88.81%	2'497'030.82	1.14	a)
US29278NAP87	2.9000 % ET 2.9 05/15/25	2'000	0	0	2'000 USD	94.38%	1'769'134.36	0.81	a)
US31428XBF24	3.2500 % FDX 3 1/4 04/01/26	2'000	0	699	1'301 USD	94.64%	1'153'955.66	0.53	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	2'000	0	1'000	1'000 USD	96.83%	907'567.29	0.41	a)
US37045XDD57	1.2500 % GM 1 1/4 01/08/26	3'000	0	0	3'000 USD	88.45%	2'487'049.11	1.14	a)
US375558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	1'100	0	0	1'100 USD	102.58%	1'057'553.54	0.48	a)
US38141GXR00	1.9920 % GS 1.992 01/27/32	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GZP26	3.0000 % GS 3 03/15/24	0	2'000	0	2'000 USD	97.41%	1'826'006.69	0.83	a)
US42824CAW91	4.9000 % HPE 4.9 10/15/25	1'500	0	300	1'200 USD	99.16%	1'115'286.26	0.51	a)
US44891CBN20	1.8000 % HYNMTR 1.8 10/15/25 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	90.62%	2'547'951.62	1.16	a)
US458140BY59	3.7500 % INTC 3 3/4 08/05/27	1'300	0	0	1'300 USD	95.02%	1'157'759.62	0.53	a)
US459506AN18	1.2300 % IFF 1.23 10/01/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	88.58%	830'169.19	0.38	a)
US46647PAV85	4.2030 % JPM 4.203 07/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	93.69%	878'090.78	0.40	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	1'700	700	200	2'200 USD	84.12%	1'734'429.86	0.79	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	0	1'000	0	1'000 USD	87.73%	822'202.56	0.38	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	0	2'000	0	2'000 USD	96.01%	1'799'763.69	0.82	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	800	0	0	800 USD	82.22%	616'508.05	0.28	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	1'750	0	300	1'450 USD	100.28%	1'362'790.55	0.62	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	900	0	0	900 USD	84.64%	713'959.56	0.33	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	4'750	0	0	4'750 USD	72.13%	3'211'048.96	1.47	a)
US595112BN22	5.3270 % MU 5.327 02/06/29	1'000	0	200	800 USD	97.65%	732'179.70	0.33	a)
US609207AY17	1.8750 % MDLZ 1 7/8 10/15/32	200	0	0	200 USD	76.03%	142'512.61	0.07	a)
US615369AE53	5.2500 % MCO 5 1/4 07/15/44	700	0	0	700 USD	95.56%	626'951.83	0.29	a)
US615369AP01	4.2500 % MCO 4 1/4 02/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	95.11%	891'380.99	0.41	a)
US61746BEF94	3.6250 % MS 3 5/8 01/20/27	1'264	0	0	1'264 USD	94.58%	1'120'509.67	0.51	a)
US63111XAE13	2.5000 % NDAQ 2 1/2 12/21/40	2'500	0	250	2'250 USD	64.95%	1'369'652.63	0.63	a)
US641062AL84	3.9000 % NESNVX 3.9 09/24/38 144A	3'000	0	1'500	1'500 USD	88.35%	1'242'132.74	0.57	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	1'000	0	0	1'000 USD	91.29%	855'578.04	0.39	a)
US66989HAR93	2.2000 % NOVNVX 2.2 08/14/30	3'000	0	400	2'600 USD	84.52%	2'059'674.36	0.94	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	100	0	0	100 USD	86.76%	81'317.68	0.04	a)
US718172BL29	4.2500 % PM 4 1/4 11/10/44	0	1'200	0	1'200 USD	79.69%	896'284.68	0.41	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	2'700	0	0	2'700 USD	84.44%	2'136'716.31	0.98	a)
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	800	0	0	800 USD	83.92%	629'224.66	0.29	a)
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	0	1'000	0	1'000 USD	88.93%	833'524.54	0.38	a)
US771196BY74	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 144A	0	1'000	0	1'000 USD	65.73%	616'091.92	0.28	a)
US806851AJ09	3.7500 % SLB 3 3/4 05/01/24 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.08%	919'273.55	0.42	a)
US842400FP31	5.5000 % EIX 5 1/2 03/15/40	1'000	0	30	970 USD	97.37%	885'195.04	0.40	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	100	0	0	100 USD	94.03%	88'128.68	0.04	a)
US87264ACX19	5.8000 % TMUS 5.8 09/15/62	0	1'000	0	1'000 USD	97.83%	916'939.79	0.42	a)
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	800	600	0	1'400 USD	77.91%	1'022'230.46	0.47	a)
US89236THP30	0.8000 % TOYOTA 0.8 10/16/25 MTN	0	1'000	0	1'000 USD	89.67%	840'460.19	0.38	a)
US911312AJ59	6.2000 % UPS 6.2 01/15/38	500	0	0	500 USD	110.66%	518'589.80	0.24	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	1'000	0	0	1'000 USD	81.78%	766'494.77	0.35	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	67.64%	633'961.76	0.29	a)
US92343VCV45	4.2720 % VZ 4.272 01/15/36	100	0	0	100 USD	88.15%	82'615.78	0.04	a)
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	50	0	0	50 USD	67.60%	31'680.92	0.01	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	800	0	0	800 USD	90.33%	677'316.83	0.31	a)
US92826CAK80	2.7000 % V 2.7 04/15/40	2'500	0	1'000	1'500 USD	74.93%	1'053'379.96	0.48	a)
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	2'000	0	0	2'000 USD	58.96%	1'105'242.69	0.50	a)
US92928QAF54	3.5000 % ULFP 3 1/2 06/15/29 144A	0	1'000	0	1'000 USD	81.64%	765'199.02	0.35	a)
USU74078CG62	1.0000 % NESNVX 1 09/15/27 REGS	3'000	0	2'000	1'000 USD	85.00%	796'653.13	0.36	a)
XS0252367775	5.0000 % AIG 5 04/26/23 EMTN	700	0	0	700 GBP	99.98%	794'102.46	0.36	a)
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	101'000	0	0	101'000 JPY	107.98%	750'418.39	0.34	a)
XS0785710046	4.8750 % T 4 7/8 06/01/44	0	500	0	500 GBP	86.09%	488'401.05	0.22	a)
X51001749289	3.1250 % MSFT 3 1/8 12/06/28	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51412266907	1.6500 % JNJ 1.65 05/20/35	700	0	700	0 EUR	0.00%	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.
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	88.63%	1'321'443.48	0.60	a)
XS1612543121	1.5000 % GE 1 1/2 05/17/29	1'000	0	0	1'000 EUR	87.72%	871'847.75	0.40	a)
XS1627602201	1.8750 % AIG 1 7/8 06/21/27	2'000	0	150	1'850 EUR	90.80%	1'669'701.01	0.76	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	100	0	0	100 EUR	92.54%	91'982.60	0.04	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	100	0	0	100 EUR	89.74%	89'198.53	0.04	a)
XS1958646082	0.5000 % CL 0 1/2 03/06/26	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2033262622	1.0010 % JPM 1.001 07/25/31 EMTN	0	900	0	900 EUR	78.81%	705'029.28	0.32	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	100	0	0	100 EUR	68.10%	67'683.38	0.03	a)
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	1'000	0	0	1'000 EUR	87.63%	871'012.83	0.40	a)
XS2115092012	1.2000 % IBM 1.2 02/11/40	0	700	0	700 EUR	64.23%	446'899.13	0.20	a)
XS2168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	3'250	0	0	3'250 EUR	85.14%	2'750'258.96	1.26	a)
XS2251337601	1.8750 % VZ 1 7/8 11/03/38	0	400	0	400 GBP	61.92%	281'047.04	0.13	a)
XS2307768734	0.6000 % GM 0.6 05/20/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2363117321	0.3000 % HND A 0.3 07/07/28	2'000	0	200	1'800 EUR	82.41%	1'474'341.61	0.67	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	1'500	0	200	1'300 EUR	75.22%	971'910.21	0.44	a)
XS2464407860	2.5000 % NESNVX 2 1/2 04/04/32 EMTN	1'000	0	100	900 GBP	84.68%	864'784.05	0.40	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	97.28%	966'879.80	0.44	a)
<b>US</b>							<b>94'155'348.93</b>	<b>43.02</b>	
US045167FM03	2.8750 % ASIA 2 7/8 05/06/25 GMTN	1'000	0	400	600 USD	96.00%	539'833.51	0.25	a)
US458182BV36	7.0000 % IADB 7 06/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	104.33%	977'832.93	0.45	a)
US4581X0CE61	4.3750 % IADB 4 3/8 01/24/44	0	4'000	2'500	1'500 USD	99.17%	1'394'220.30	0.64	a)
US45905CAA27	4.7500 % IBRD 4 3/4 02/15/35 GMTN	4'800	0	4'000	800 USD	104.30%	782'071.39	0.36	a)
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	3'000	0	0	3'000 USD	94.94%	2'669'503.57	1.22	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	740	0	0	740 USD	78.95%	547'576.50	0.25	a)
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	2'000	0	0	2'000 JPY	107.68%	14'817.66	0.01	a)
XS1505567088	0.8750 % EIB 0 7/8 09/13/47 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	58.93%	644'256.87	0.29	a)
XS2055744689	0.1500 % EUROF 0.15 10/10/34 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	69.22%	1'031'978.89	0.47	a)
<b>XS</b>							<b>8'602'091.62</b>	<b>3.93</b>	

#### Nicht kotierte Wertpapiere

0.00 0.00

#### Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

0.00 0.00

XS1041815116	4.6000 % RURAIL 4.6 03/06/23	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
--------------	------------------------------	-------	---	-------	-------	-------	------	------	--

IE

0.00 0.00

#### Derivative Finanzinstrumente

748.63 0.00

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/CHF Verfall 11.10.2022	6'841'617	6'975'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 11.10.2022	281'946	40'050'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 11.10.2022	1'267'733	1'119'000	CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 11.10.2022	19'497'217	20'040'000	CHF/USD	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 11.10.2022	736'753	992'000	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 11.10.2022	322'991	484'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	300'000	291'941	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 11.10.2022	100'000	74'304	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	120'000	117'880	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	130'000	127'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 11.10.2022	15'000	17'011	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	200'000	195'941	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 11.10.2022	291'294	300'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 11.10.2022	115'101	120'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	130'000	124'574	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	130'000	125'248	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	450'000	441'287	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 11.10.2022	50'000	53'498	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 11.10.2022	180'000	171'489	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 11.10.2022	270'000	266'989	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 11.10.2022	30'000	31'998	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 11.10.2022	50'000	47'632	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 11.10.2022	60'000	56'731	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.
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		150'000	147'105		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		120'000	118'851		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.10.2022		13'000	9'450		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.10.2022		16'000	10'328		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		60'000	67'148		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		187'187	190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		296'876	468'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		635'658	879'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		6'486'389	6'685'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		18'364'871	18'550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		1'063'147	964'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		273'730	40'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		120'000	118'835		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		250'000	249'614		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		80'000	77'558		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		79'726	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		80'000	78'062		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		350'000	351'023		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		2'000'000	13'658		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		12'000	13'554		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		13'000	9'422		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		10'000	6'267		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		250'000	250'064		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		150'000	150'716		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		50'000	49'264		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		246'720	250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		89'264	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		17'715'387	17'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		1'094'205	952'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		256'201	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		292'372	458'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		633'375	866'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		6'486'010	6'565'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		50'000	49'828		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		30'000	29'668		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		250'000	252'698		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		56'497	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		199'079	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		59'198	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		241'323	250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		59'023	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		566'385	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		146'383	150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		122'640	130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		141'165	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		98'014	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		47'056	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		94'599	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		94'454	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		6'702'966	6'845'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		259'752	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		291'277	458'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'109'188	19'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		606'044	866'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		1'132'981	1'002'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		600'000	569'034		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		100'000	97'961		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		93'471	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		234'240	250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		78'710	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		93'416	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		200'000	186'665		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		50'000	49'342		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		279'946	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		200'000	184'722		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		80'177	70'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		138'882	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		150'000	138'649		USD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		23'054	34'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		9'214	15'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		250'000	231'924		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		100'000	98'591		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.
CHF/USD	Verfall 06.01.2023		170'000	159'518		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.01.2023		40'000	39'645		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.01.2023		15'000	16'927		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.01.2023		12'000	8'285		CAD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		17'082'214	18'430'000		CHF/USD	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2023		300'782	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2023		268'040	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2023		608'530	888'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2023		1'180'686	1'057'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2023		70'000	64'913		USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023		6'532'854	6'635'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		140'263	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		366'467	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023		108'412	110'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		184'908	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023		110'253	110'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		273'495	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023		98'826	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2023		100'000	91'634		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2023		50'000	49'479		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2023		200'000	184'540		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2023		70'000	70'296		EUR/CHF	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2023		67'387	59'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.03.2023		6'811'611	6'835'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2023		17'503'461	19'110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.03.2023		1'259'205	1'116'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.03.2023		269'013	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.03.2023		305'629	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.03.2023		609'674	888'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		260'000	238'200		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2023		70'000	69'793		EUR/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2023		127'596	140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2023		73'601	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		180'000	166'717		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		120'000	110'600		USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.03.2023		78'888	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.03.2023		78'919	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		200'000	183'995		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		100'000	92'543		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.03.2023		20'000	22'258		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.03.2023		19'000	13'097		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		170'000	157'593		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2023		60'000	59'361		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		100'000	92'956		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2023		220'000	217'400		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2023		170'000	159'330		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2023		70'000	69'572		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.03.2023		20'000	22'568		GBP/CHF	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.04.2023		1'217'215	1'076'000		CHF/GBP	65.81	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		6'524'313	6'575'000		CHF/EUR	-95.82	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 04.04.2023		596'230	869'000		CHF/CAD	-12.08	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 04.04.2023		262'062	38'050'000		CHF/JPY	-45.34	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 04.04.2023		298'224	473'000		CHF/AUD	-19.40	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		16'836'991	18'030'000		CHF/USD	229.09	0.00	b)
<b>Klasse A hedged</b>							<b>122.26</b>	<b>0.00</b>	
JPY/CHF	Verfall 11.10.2022		100'367	14'257'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		2'485'542	2'534'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.10.2022		461'097	407'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.10.2022		116'117	174'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.10.2022		265'142	357'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		7'041'959	7'238'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		150'000	145'970		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 11.10.2022		37'000	27'511		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		50'000	49'134		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		40'000	39'153		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		10'000	11'358		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		130'000	127'000		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		25'000	24'569		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		60'000	58'800		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		97'087	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		76'725	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		24'101	25'000		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.
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		30'000	28'771		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		40'000	38'451		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		20'000	19'240		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	48'191		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		30'000	29'006		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		140'000	137'291		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		50'000	47'656		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		25'000	26'764		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		100'000	98'895		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		25'000	23'831		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		15'000	16'014		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	49'055		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		20'000	18'930		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	49'213		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	49'539		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		30'000	29'206		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.10.2022		10'000	7'276		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.10.2022		9'000	5'823		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	49'073		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'465		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		20'000	22'403		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		78'802	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		104'668	165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		224'180	310'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		2'269'508	2'339'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		371'660	337'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		6'433'150	6'498'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		40'000	39'632		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		91'975	13'457'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		30'000	29'084		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		90'000	89'861		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		29'879	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		110'000	110'329		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		20'000	19'538		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		5'000	5'665		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		10'000	7'254		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		9'000	5'643		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		100'000	100'036		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		20'000	20'121		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		24'774	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		88'808	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		381'593	332'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		6'242'280	6'258'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		90'610	13'457'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		99'585	156'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		219'414	300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		2'286'158	2'314'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		70'000	69'747		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		75'000	75'824		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		35'000	34'608		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		22'581	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		49'750	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		34'519	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		72'381	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		24'576	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		58'535	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		207'675	220'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		42'433	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		47'035	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		29'383	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		28'221	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		28'359	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		37'764	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		2'344'325	2'394'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		91'866	13'457'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		99'212	156'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		6'341'060	6'688'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		209'946	300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		398'013	352'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		210'000	199'162		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		30'000	29'409		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		28'020	30'000		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.
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		74'942	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		24'577	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		46'693	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		46'625	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		93'304	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		39'334	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		60'000	55'435		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		34'344	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		37'013	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		50'000	46'236		USD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		13'549	20'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		7'982	13'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		80'000	74'231		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		50'000	49'311		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		70'000	65'701		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		10'000	9'934		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.01.2023		5'000	5'662		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		10'000	6'910		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		4'000	2'561		AUD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		104'924	165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		6'087'682	6'568'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		94'797	13'457'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		2'332'529	2'369'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		421'115	377'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		212'437	310'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		30'000	27'837		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		20'000	19'723		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		137'422	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		49'262	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		55'454	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		55'123	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		49'661	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		72'917	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		19'741	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		20'000	18'351		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		15'000	14'865		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		60'000	55'352		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		20'000	20'106		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		27'620	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		50'000	46'175		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		22'823	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		2'425'671	2'434'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		447'943	397'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		6'217'346	6'788'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		95'141	13'457'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		106'615	165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		212'837	310'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		70'000	64'148		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		30'000	29'928		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		45'551	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		36'786	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		70'000	64'851		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		50'000	46'101		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		29'564	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		39'444	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		50'000	46'020		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		25'000	23'158		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		6'000	6'698		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		65'000	60'274		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		25'000	24'751		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		32'349	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		35'000	32'554		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		60'000	59'309		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		50'000	46'690		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		20'000	19'810		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		50'000	46'882		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		20'000	19'899		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		442'315	391'000		CHF/GBP	23.91	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		2'330'892	2'349'000		CHF/EUR	-34.23	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		92'683	13'457'000		CHF/JPY	-16.04	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		212'694	310'000		CHF/CAD	-4.31	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		104'032	165'000		CHF/AUD	-6.77	0.00	b)

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 04.04.2023		6'021'349	6'448'000	CHF/USD		81.93	0.00	b)
<b>Klasse B hedged</b>							<b>44.49</b>	<b>0.00</b>	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		155'966	210'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		68'068	102'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		1'445'813	1'474'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		4'135'862	4'251'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		266'235	235'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		58'853	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		45'000	43'812	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.10.2022		20'000	14'885	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		40'000	39'313	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		25'000	24'447	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		40'000	39'210	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		53'384	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		47'941	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		19'275	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		20'000	19'191	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		20'000	19'294	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		90'000	88'269	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		10'000	10'724	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		60'000	59'349	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		15'000	14'311	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		8'000	8'555	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		25'000	24'542	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		10'000	9'610	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		20'000	19'834	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		10'000	11'216	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		39'386	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		57'138	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		3'946'220	3'986'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		137'400	190'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		228'290	207'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		1'391'396	1'434'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		64'704	102'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		30'000	29'731	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		50'000	49'923	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		20'000	19'390	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		24'894	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		70'000	70'221	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		4'000	4'538	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		5'000	3'642	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		5'000	3'148	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		60'000	60'033	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		15'000	14'805	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		15'000	15'099	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		59'195	60'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		19'813	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		135'305	185'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		233'323	203'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		1'401'927	1'419'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		61'922	97'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		56'290	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		3'836'339	3'846'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		60'000	60'665	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		22'581	20'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		39'794	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		14'777	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		53'071	55'000	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		127'433	135'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		34'133	35'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		23'560	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		28'209	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'677	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		18'804	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		18'896	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		23'591	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		252'151	223'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		129'467	185'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		61'690	97'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		57'070	8'360'000	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.
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		3'935'667	4'151'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		1'453'207	1'484'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		20'000	19'616		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		130'000	123'296		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'670	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		46'828	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		19'655	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		28'004	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'632	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		65'304	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		24'573	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		40'000	36'967		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		17'157	15'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		23'122	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		29'000	26'830		USD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		10'154	15'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		4'900	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		50'000	46'405		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		35'000	34'527		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		35'000	32'865		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.01.2023		5'000	5'662		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		7'000	4'846		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		1'451'308	1'474'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		132'259	193'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		260'265	233'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		3'783'483	4'082'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		66'770	105'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		58'891	8'360'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		15'000	13'934		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		10'000	9'876		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		82'442	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		24'616	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		36'959	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		32'143	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		29'785	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		45'562	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		14'798	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		15'000	13'771		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		10'000	9'920		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		40'000	36'911		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		15'000	15'087		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		23'012	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		17'110	15'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		3'894'543	4'252'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		132'508	193'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		279'823	248'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'503'836	1'509'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		67'846	105'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		59'105	8'360'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		45'000	41'249		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		31'876	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		18'378	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		45'000	41'701		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		30'000	27'673		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		14'767	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		29'576	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		20'000	18'426		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		24'000	22'233		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		40'000	37'103		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		17'000	16'840		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		4'000	4'479		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		18'472	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		15'000	13'969		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		35'000	34'609		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		50'000	46'882		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		25'000	24'866		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		1'465'614	1'477'000		CHF/EUR	-21.53	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		3'789'490	4'058'000		CHF/USD	51.57	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		276'023	244'000		CHF/GBP	14.92	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		66'202	105'000		CHF/AUD	-4.30	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		57'578	8'360'000		CHF/JPY	-9.96	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		132'419	193'000		CHF/CAD	-2.68	0.00	b)

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>Klasse It hedged</b>							<b>28.02</b>	<b>0.00</b>	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		30'907'434	31'510'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		1'274'220	181'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		5'766'542	5'090'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		1'442'933	2'162'225	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		88'058'537	90'510'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		3'291'754	4'432'175	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		1'200'000	1'167'762	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.10.2022		400'000	297'154	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		700'000	687'596	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		600'000	586'138	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		100'000	113'234	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		700'000	685'794	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		1'262'275	1'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		863'313	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		289'515	300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		600'000	574'932	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		400'000	385'362	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		1'800'000	1'765'147	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		700'000	666'903	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		170'000	181'826	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		1'300'000	1'285'502	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		200'000	213'163	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		400'000	380'891	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		500'000	490'349	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		220'000	210'796	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		600'000	594'227	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		200'000	223'770	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		788'158	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		29'584'142	30'490'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		1'371'607	2'162'225	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		83'864'594	84'710'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		1'237'089	181'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		2'915'908	4'032'175	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		4'874'597	4'420'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		600'000	594'147	USD/CHF		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		400'000	387'791	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		398'700	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		1'500'000	1'504'383	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		200'000	195'120	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		4'000'000	27'286	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		50'000	56'381	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		60'000	43'376	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		55'000	34'331	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		1'200'000	1'200'307	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		500'000	502'386	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		247'989	250'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		1'332'289	1'350'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		1'191'797	177'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		2'905'169	3'972'175	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		5'022'769	4'370'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		29'777'356	30'140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		1'345'183	2'107'225	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		81'454'870	81'660'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		1'000'000	1'010'790	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		282'580	250'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		796'318	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		250'000	247'215	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		490'995	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		1'158'349	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		738'015	750'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		2'643'130	2'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		634'325	650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		566'055	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		658'776	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		392'096	400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		800'000	760'030	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		376'608	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		709'578	750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		566'792	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		31'032'433	31'690'000	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.
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		83'634'106	88'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		1'208'315	177'001'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		5'223'926	4'620'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		2'779'808	3'972'175		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		1'340'142	2'107'225		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		2'750'000	2'608'073		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		400'000	391'804		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		467'411	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		843'264	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		246'015	250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		653'988	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		464'840	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		1'119'785	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		393'562	400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		738'542	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		442'900	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		515'512	450'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		700'000	647'021		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		200'000	196'965		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		200'242	295'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		83'170	135'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		900'000	834'926		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		500'000	492'907		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		900'000	844'509		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		100'000	68'826		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		50'000	31'664		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		100'000	99'067		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		1'246'869	177'001'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		31'103'672	31'590'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		81'156'737	87'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		1'394'040	2'192'225		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		5'663'271	5'070'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		2'855'690	4'167'175		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		400'000	370'836		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		100'000	98'493		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2023		80'000	89'394		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'649'102	1'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		295'691	300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		739'632	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		689'280	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		695'535	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'139'563	1'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		395'344	400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		400'000	366'486		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		250'000	247'295		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		1'000'000	922'212		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		300'000	301'198		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		552'893	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		377'002	330'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		1'416'506	2'192'225		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		83'313'175	90'960'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		1'251'394	177'001'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		2'861'057	4'167'175		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		6'002'662	5'320'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		32'229'333	32'340'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		1'000'000	916'152		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		729'146	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		322'075	350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		900'000	833'587		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		700'000	645'119		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		246'568	250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		591'992	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		500'000	459'988		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		500'000	462'658		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		100'000	98'820		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		70'000	77'828		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		900'000	834'314		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		200'000	197'811		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		508'704	550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		5'200'000	4'833'150		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		2'600'000	2'569'268		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		250'000	280'395		GBP/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/CAD Verfall 02.03.2023		195'000	133'861		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		37'000	23'486		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		350'000	347'778		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		900'000	843'512		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		60'000	67'644		GBP/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		29'709'193	29'940'000		CHF/EUR	-436.34	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		76'630'254	82'060'000		CHF/USD	1'042.65	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		5'588'331	4'940'000		CHF/GBP	302.11	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		2'725'353	3'972'175		CHF/CAD	-55.22	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		1'358'859	2'155'225		CHF/AUD	-88.44	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'219'061	177'001'000		CHF/JPY	-210.90	0.00	b)
<b>Klasse Nt hedged</b>							<b>553.86</b>	<b>0.00</b>	
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>748.63</b>	<b>0.00</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'045'888.94	0.48
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	215'328'981.95	98.38
Derivative Finanzinstrumente	748.63	0.00
Sonstige Vermögenswerte	2'494'512.21	1.14
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>218'870'131.73</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-47'761.48	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>218'822'370.25</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	214'434'422.32	97.97
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	748.63	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	894'559.63	0.41

## Devisenkurse

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

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	158'440'641.45	72.406

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

Periode: 01.09.2022 - 28.02.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
A	CHF	0.15	-	0.15	-
A hedged	CHF	0.15	-	0.15	-
B	CHF	0.15	-	0.15	-
B hedged	CHF	0.15	-	0.15	-
It	CHF	0.15	-	0.15	-
It hedged	CHF	0.15	-	0.15	-
Nt	CHF	0.15	-	0.15	-
Nt hedged	CHF	0.15	-	0.15	-

## 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	0.900	1.000	-
A hedged	0.950	1.000	-
B	0.900	1.000	-
B hedged	0.950	1.000	-
It	0.330	0.400	-
It hedged	0.380	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 Credit 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.