



BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL UNTERNEHMENSANLEIHEN

Jahresbericht per 31.08.2023

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

Klasse	Valor	Währung
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 zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 20.12.2023

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

BEKB Obligationenfonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ BEKB Obligationen CHF
- ▶ BEKB Obligationen Global Staatsanleihen
- ▶ BEKB Obligationen Global Unternehmensanleihen
- ▶ BEKB Obligationen Nachhaltig CHF
- ▶ BEKB Obligationen Nachhaltig Global
- ▶ BEKB Obligationen CHF Short Duration

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes KAG

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	30
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	30
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	30
7	Verwaltungskommission	31
8	Benchmark	31
9	TER	31
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	32
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	32
12	Fussnoten	32
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	33
14	Pflichtpublikationen	35

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

Anlageentscheide 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	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021	31.08.2020
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		216'258'253.68	238'327'186.88	315'060'973.10	349'123'578.69
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'801'334.16	16'592'397.12	21'865'916.63	24'572'455.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		188'334.000	204'241.000	224'584.000	253'177.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.28	81.24	97.36	97.06
Ausschüttung je Anteil		1.70	1.95	2.00	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse A hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'626'422.14	28'736'778.31	41'562'184.33	46'482'147.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		334'839.090	368'122.818	431'485.627	472'045.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.55	78.06	96.32	98.47
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.90	1.80	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'670'569.23	7'840'057.52	10'402'760.86	10'560'422.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		82'522.613	88'967.000	99'898.252	103'093.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.83	88.12	104.13	102.44
Thesaurierung je Anteil		1.86	2.04	2.03	2.17
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse B hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'011'003.79	10'397'685.27	18'565'109.56	19'385'295.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		111'169.895	122'838.000	179'947.000	186'315.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.06	84.65	103.17	104.05
Thesaurierung je Anteil		1.78	1.96	1.98	2.05
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'514'163.25	3'394'278.18	4'346'122.13	3'068'723.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		41'114.679	36'553.534	39'755.534	28'641.855
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.47	92.86	109.32	107.14
Thesaurierung je Anteil		2.46	2.72	2.74	2.88
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
Klasse It hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'062'729.80	6'106'350.10	7'997'325.24	7'371'627.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		72'206.000	69'846.000	75'276.000	68'999.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.96	87.43	106.24	106.84
Thesaurierung je Anteil		2.32	2.57	2.64	2.69
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %

	von	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020	01.09.2019
	bis	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021	31.08.2020
Klasse Nt	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		31'567'037.01	35'450'023.58	42'174'095.80	34'891'197.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		354'012.852	366'609.917	371'192.076	313'953.093
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.17	96.70	113.62	111.14
Thesaurierung je Anteil		2.84	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		121'004'994.30	129'809'616.80	168'147'458.55	202'791'709.90
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'418'252.686	1'465'545.213	1'567'074.702	1'885'373.849
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.32	88.57	107.30	107.56
Thesaurierung je Anteil		2.65	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	-7.51 %	-17.60 %	-1.38 %	-0.06 %
Klasse A hedged	-3.39 %	-18.87 %	-3.38 %	5.06 %
Klasse B	-7.50 %	-17.59 %	-1.38 %	-0.07 %
Klasse B hedged	-3.45 %	-18.87 %	-3.39 %	5.03 %
Klasse It	-6.98 %	-17.13 %	-0.82 %	0.51 %
Klasse It hedged	-2.96 %	-18.49 %	-2.86 %	5.54 %
Klasse Nt	-6.69 %	-16.87 %	-0.52 %	0.81 %
Klasse Nt hedged	-2.52 %	-18.12 %	-2.48 %	5.97 %
Benchmark Hedge	-2.86 %	-16.79 %	-	-
Benchmark	-6.91 %	-15.68 %	-0.23 %	0.44 %
Tracking Error 33)	0.49 %	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	-0.60 %
Klasse A hedged	-0.53 %
Klasse B	-0.59 %
Klasse B hedged	-0.59 %
Klasse It	-0.07 %
Klasse It hedged	-0.10 %
Klasse Nt	0.22 %
Klasse Nt hedged	0.34 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2023	31.08.2022
Bankguthaben auf Sicht	2'096'903.70	1'431'369.90
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	214'221'957.20	234'619'442.86
Derivative Finanzinstrumente	-2'436'292.89	20'787.07
Sonstige Vermögenswerte	2'425'090.35	2'317'857.31
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	216'307'658.36	238'389'457.14
Andere Verbindlichkeiten	-49'404.68	-62'270.26
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	216'258'253.68	238'327'186.88

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Klasse A			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		204'241.000	224'584.000
Ausgegebene Anteile		2'760.000	375.000
Zurückgenommene Anteile		-18'667.000	-20'718.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		188'334.000	204'241.000
Klasse A hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		368'122.818	431'485.627
Ausgegebene Anteile		3'873.000	2'812.889
Zurückgenommene Anteile		-37'156.728	-66'175.698
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		334'839.090	368'122.818
Klasse B			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		88'967.000	99'898.252
Ausgegebene Anteile		4'318.613	2'328.748
Zurückgenommene Anteile		-10'763.000	-13'260.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		82'522.613	88'967.000
Klasse B hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		122'838.000	179'947.000
Ausgegebene Anteile		120.000	-
Zurückgenommene Anteile		-11'788.105	-57'109.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		111'169.895	122'838.000
Klasse It			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		36'553.534	39'755.534
Ausgegebene Anteile		4'561.145	-
Zurückgenommene Anteile		-	-3'202.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		41'114.679	36'553.534
Klasse It hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		69'846.000	75'276.000
Ausgegebene Anteile		2'360.000	2'000.000
Zurückgenommene Anteile		-	-7'430.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		72'206.000	69'846.000
Klasse Nt			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		366'609.917	371'192.076
Ausgegebene Anteile		7'812.029	32'222.188
Zurückgenommene Anteile		-20'409.094	-36'804.347
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		354'012.852	366'609.917
Klasse Nt hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'465'545.213	1'567'074.702
Ausgegebene Anteile		149'425.328	244'241.661
Zurückgenommene Anteile		-132'717.855	-345'771.150
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-64'000.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'418'252.686	1'465'545.213

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

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

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
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		-9'609'019.21	-23'971'802.77
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-9'231'903.66	-49'233'404.38
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		216'258'253.68	238'327'186.88

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		34'878.88	0.74
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-483.24	-13'629.85
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		6'954'357.13	8'431'715.65
Sonstige Erträge		0.00	-0.02
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		181'693.14	557'542.25
Total Ertrag		7'170'445.91	8'975'628.77
Aufwand			
Passivzinsen		-2.95	-3'127.04
Reglementarische Vergütungen		-618'020.77	-814'023.66
Sonstige Aufwendungen		-1.15	-379.45
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-299'727.40	-933'536.34
Total Aufwand		-917'752.27	-1'751'066.49
Nettoertrag / Verlust		6'252'693.64	7'224'562.28
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-12'705'303.35	-16'605'448.81
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		51'390.79	116'962.39
Realisierter Erfolg		-6'401'218.92	-9'263'924.14
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'830'684.74	-39'969'480.24
Gesamterfolg		-9'231'903.66	-49'233'404.38

Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	318'604.60	384'265.06
Vortrag des Vorjahres	4'553.29	18'558.18
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	323'157.89	402'823.24
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	320'167.80	398'269.95
Vortrag auf neue Rechnung	2'990.09	4'553.29
Total	323'157.89	402'823.24
Klasse A hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	541'909.84	662'638.82
Vortrag des Vorjahres	8'569.24	45'363.77
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	550'479.08	708'002.59
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	535'742.54	699'433.35
Vortrag auf neue Rechnung	14'736.54	8'569.24
Total	550'479.08	708'002.59
Klasse B	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	153'581.00	181'691.70
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	153'581.00	181'691.70
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	53'753.35	63'592.10
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	99'827.65	118'099.60
Total	153'581.00	181'691.70
Klasse B hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	197'905.32	241'394.57
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	197'905.32	241'394.57
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	69'266.86	84'488.10
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	128'638.46	156'906.47
Total	197'905.32	241'394.57
Klasse It	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	101'271.05	99'475.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	101'271.05	99'475.73
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	35'444.87	34'816.51
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	65'826.18	64'659.22
Total	101'271.05	99'475.73
Klasse It hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	167'676.62	180'053.48
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	167'676.62	180'053.48
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	58'686.82	63'018.72
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	108'989.80	117'034.76
Total	167'676.62	180'053.48
Klasse Nt	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	1'005'624.64	1'152'920.66
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'005'624.64	1'152'920.66
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	351'968.62	403'522.23
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	653'656.02	749'398.43
Total	1'005'624.64	1'152'920.66
Klasse Nt hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	3'766'120.57	4'322'122.26
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'766'120.57	4'322'122.26
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'318'142.20	1'512'742.79
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'447'978.37	2'809'379.47
Total	3'766'120.57	4'322'122.26

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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							214'221'957.20	99.04	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							214'221'957.20	99.04	
AU000XCLWA18	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	2'000	0	0	2'000 AUD	101.24%	1'158'283.12	0.54	a)
US00205GAC15	5.0000 % APAAU 5 03/23/35 144A	0	1'000	0	1'000 USD	91.93%	811'945.23	0.38	a)
US55607PAG00	2.6910 % MQGAU 2.691 06/23/32 144A	0	1'000	0	1'000 USD	78.58%	694'057.85	0.32	a)
US89400PAE34	4.1250 % TCLAU 4 1/8 02/02/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	96.41%	2'554'729.97	1.18	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	95.94%	1'694'815.43	0.78	a)
XS2315784715	0.7500 % APAAU 0 3/4 03/15/29 EMTN	0	450	0	450 EUR	82.44%	355'639.55	0.16	a)
XS2575952937	3.7990 % WSTP 3.799 01/17/30 EMTN	0	1'400	0	1'400 EUR	99.16%	1'330'872.23	0.62	a)
AU							8'600'343.38	3.98	
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	83.23%	957'448.52	0.44	a)
BE							957'448.52	0.44	
CA06368BTX69	3.1900 % BMO 3.19 03/01/28 DPNT	2'000	0	60	1'940 CAD	92.73%	1'174'471.88	0.54	a)
CA07813ZCG78	3.0000 % BCECN 3 03/17/31 MTN	0	400	0	400 CAD	85.30%	222'754.35	0.10	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	1'400	0	100	1'300 CAD	96.02%	814'913.43	0.38	a)
CA44810ZAS98	4.8900 % HYDONE 4.89 03/13/37 MTN	0	500	0	500 CAD	99.35%	324'304.44	0.15	a)
CA628153AA60	3.6300 % CANMFA 3.63 06/01/29 A	2'100	0	0	2'100 CAD	97.35%	1'334'591.11	0.62	a)
CA87971MAS22	4.4000 % TCN 4.4 04/01/43 MTN	0	250	0	250 CAD	83.31%	135'967.10	0.06	a)
CA87971MBV42	2.8500 % TCN 2.85 11/13/31 CAF	0	400	0	400 CAD	82.66%	215'842.16	0.10	a)
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	2'000	0	60	1'940 CAD	98.63%	1'249'119.12	0.58	a)
US06417XAP69	4.8500 % BNS 4.85 02/01/30	0	1'000	0	1'000 USD	96.74%	854'491.38	0.40	a)
US13645RAX26	6.1250 % CP 6 1/8 09/15/2115	0	200	0	200 USD	103.66%	183'108.32	0.08	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	2'000	0	0	2'000 USD	115.29%	2'036'615.52	0.94	a)
US89352HBA68	4.1000 % TRPCN 4.1 04/15/30	0	1'000	0	1'000 USD	91.66%	809'586.95	0.37	a)
XS1945965611	0.8750 % CPPIBC 0 7/8 02/06/29 EMTN	800	0	0	800 EUR	88.04%	675'179.70	0.31	a)
XS2163020790	1.1250 % CPPIBC 1 1/8 12/14/29 EMTN	1'600	0	1'600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
CA							10'030'945.46	4.64	
CH0591979627	0.6250 % UBS 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	90.72%	1'130'528.55	0.52	a)
US225401AC20	4.2820 % CS 4.282 01/09/28 144A	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH3698DDR29	6.3730 % UBS 6.373 07/15/26 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
CH							1'130'528.55	0.52	
XS1084942470	2.2500 % CDEL 2 1/4 07/09/24 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	97.96%	1'878'142.89	0.87	a)
XS1346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	2'000	0	1'000	1'000 EUR	94.40%	904'943.96	0.42	a)
XS2388560604	0.5550 % CHILE 0.555 01/21/29	2'000	0	0	2'000 EUR	83.19%	1'594'903.93	0.74	a)
CL							4'377'990.78	2.02	
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	90.43%	866'905.23	0.40	a)
DE000LB2CQX3	1.5000 % LBBW 1 1/2 02/03/25	0	800	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
US251526CC16	2.2220 % DB 2.222 09/18/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	0	800	0	800 USD	98.03%	692'644.65	0.32	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	7'000	0	7'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	6'000	0	6'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2035038731	1.8750 % NRWK 1 7/8 07/31/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	85.99%	1'139'220.27	0.53	a)
XS2484327999	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 05/24/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.41%	175'252.31	0.08	a)
DE							2'874'022.46	1.33	
XS2046595836	0.5000 % DANBNK 0 1/2 08/27/25	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	700	0	0	700 GBP	86.26%	675'832.87	0.31	a)
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 GBP	100.90%	3'387'782.24	1.57	a)
DK							4'063'615.11	1.88	
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	91.56%	1'617'460.40	0.75	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	97.08%	930'664.20	0.43	a)
XS2058729653	0.3750 % BBVASM 0 3/8 10/02/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2645245122	0.9130 % SANSFC 0.913 07/07/26 EMTN	0	100'000	0	100'000 JPY	99.37%	602'855.72	0.28	a)
XS2676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	0	700	0	700 EUR	100.53%	674'595.89	0.31	a)
ES							3'825'576.21	1.77	
US65559CAE12	1.5000 % NDASS 1 1/2 09/30/26 144A	0	800	0	800 USD	88.20%	623'221.20	0.29	a)
XS2185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	800	0	150	650 EUR	93.27%	581'147.46	0.27	a)
FI							1'204'368.66	0.56	
AU3CB0252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	2'000	0	0	2'000 AUD	93.23%	1'066'574.17	0.49	a)
FR0013248523	1.5000 % VIEFP 1 1/2 04/03/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	800	0	200	600 EUR	86.71%	498'723.35	0.23	a)
FR0013464963	4.5000 % EDF 4 1/2 12/04/69 EMTN	0	600	0	600 USD	68.24%	361'653.78	0.17	a)
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	700	400	1'100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0013515749	1.2500 % BFCM 1 1/4 06/03/30	0	900	0	900 EUR	81.79%	705'653.82	0.33	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	800	0	0	800 EUR	80.62%	618'313.34	0.29	a)
FR0013532280	0.5000 % BNP 0 1/2 09/01/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014000717	0.6250 % BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN	0	900	0	900 EUR	76.76%	662'221.81	0.31	a)
FR0014001EW8	0.0000 % ALOFP 0 01/11/29	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LK5	0.8750 % BNP 0 7/8 07/11/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	81.54%	1'563'268.90	0.72	a)
FR001400EHG3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 12/06/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	97.25%	932'313.05	0.43	a)
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	0	700	0	700 EUR	99.70%	669'039.63	0.31	a)
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	0	100'000	0	100'000 JPY	99.58%	604'117.63	0.28	a)
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	0	1'000	0	1'000 USD	95.19%	840'730.35	0.39	a)
US35177PAX50	5.3750 % ORAFP 5 3/8 01/13/42	0	1'000	0	1'000 USD	95.80%	846'153.50	0.39	a)
USF1R15XK516	4.3750 % BNP 4 3/8 05/12/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	96.28%	1'700'786.20	0.79	a)
USF43628C650	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 08/19/26 REGS	500	0	0	500 USD	94.03%	415'259.99	0.19	a)
XS0878743623	5.1250 % AXASA 5 1/8 07/04/43 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2451372499	1.2500 % ALDFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	0	1'400	0	1'400 EUR	93.24%	1'251'313.01	0.58	a)
FR							12'736'122.53	5.89	
JP582667AJ57	0.6500 % LLOYDS 0.65 05/30/23 6	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US046353AD01	6.4500 % AZN 6.45 09/15/37	0	1'000	0	1'000 USD	112.45%	993'214.63	0.46	a)
US06738EAP07	5.2000 % BACR 5.2 05/12/26	2'000	0	0	2'000 USD	97.11%	1'715'395.16	0.79	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	2'000	0	0	2'000 USD	121.77%	2'151'067.05	0.99	a)
US111021AM38	4.5000 % BRITEL 4 1/2 12/04/23	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	0	1'000	0	1'000 USD	94.40%	833'743.84	0.39	a)
US404280DA42	2.9990 % HSBC 2.999 03/10/26	0	500	0	500 USD	95.44%	421'473.65	0.19	a)
US53944YAB92	4.6500 % LLOYDS 4.65 03/24/26	2'000	0	0	2'000 USD	96.52%	1'704'955.14	0.79	a)
US780097BK63	4.2690 % NWG 4.269 03/22/25	0	2'000	0	2'000 USD	98.88%	1'746'662.21	0.81	a)
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	1'000	500	0	1'500 USD	79.11%	1'048'161.61	0.48	a)
US853254CG39	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 144A	0	1'500	0	1'500 USD	89.31%	1'183'272.36	0.55	a)
US92857WAB63	6.2500 % VOD 6 1/4 11/30/32	100	0	0	100 USD	104.64%	92'425.93	0.04	a)
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	200	0	0	200 USD	90.23%	159'389.53	0.07	a)
US92857WBS89	4.8750 % VOD 4 7/8 06/19/49	0	500	0	500 USD	84.76%	374'308.10	0.17	a)
US92857WBZ23	5.7500 % VOD 5 3/4 02/10/63	0	700	0	700 USD	92.87%	574'185.81	0.27	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPLN 3 3/4 09/19/24	2'000	0	0	2'000 USD	97.23%	1'717'532.62	0.79	a)
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	0	900	0	900 USD	100.32%	797'468.76	0.37	a)
XS0097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	100	0	0	100 GBP	98.97%	110'769.36	0.05	a)
XS0158715713	5.9000 % VOD 5.9 11/26/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.60%	112'597.03	0.05	a)
XS0159497162	5.7500 % HSBC 5 3/4 12/20/27 EMTN	600	0	600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0753789980	4.3750 % CNALN 4 3/8 03/13/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	92.95%	1'040'294.73	0.48	a)
XS1083226321	4.7500 % MRWLN 4 3/4 07/04/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1171485722	1.1250 % WELLTR 1 1/8 01/21/27	300	500	0	800 EUR	91.73%	703'478.68	0.33	a)
XS1345415472	3.6250 % SANUK 3 5/8 01/14/26 EMTN	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1480699641	4.3000 % STANLN 4.3 02/19/27 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1550975079	3.1250 % BACR 3 1/8 01/17/24 EMTN	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1637333748	1.5000 % BRITEL 1 1/2 06/23/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	100	0	0	100 GBP	86.23%	96'510.62	0.04	a)
XS2525246901	3.2500 % NWISE 3 1/4 09/05/29 EMTN	0	500	0	500 EUR	95.10%	455'836.80	0.21	a)
XS2659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	0	100	0	100 GBP	97.95%	109'626.64	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52669894821	6.1250 % NWDIE 6 1/8 08/21/28 EMTN	0	600	0	600 GBP	100.52%	675'031.51	0.31	a)
GB							18'817'401.77	8.70	
X51268430201	3.3750 % INDON 3 3/8 07/30/25 REGS	0	1'000	0	1'000 EUR	98.54%	944'669.89	0.44	a)
ID							944'669.89	0.44	
X51041815116	4.6000 % RURAIL 4.6 03/06/23	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51108784510	4.5000 % SRENVX 4 1/2 09/11/44	2'000	0	0	2'000 USD	95.80%	1'692'289.34	0.78	a)
X51385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	1'000	0	500	500 USD	97.28%	429'630.47	0.20	a)
X51843437036	2.2000 % RURAIL 2.2 05/23/27	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	77.81%	962'147.19	0.44	a)
IE							3'084'067.00	1.43	
X50986194883	4.0000 % ISPIM 4 10/30/23 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.98%	95'848.38	0.04	a)
X51785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.62%	86'871.71	0.04	a)
X52265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	700	0	0	700 EUR	87.80%	589'178.44	0.27	a)
X52348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	88.68%	1'566'443.88	0.72	a)
IT							2'338'342.41	1.08	
U590351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	3'250	0	250	3'000 USD	95.92%	2'541'693.20	1.18	a)
X52242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	2'000	0	0	2'000 EUR	94.76%	1'816'732.59	0.84	a)
JE							4'358'425.79	2.01	
U565535HAP47	2.6480 % NOMURA 2.648 01/16/25	0	1'000	0	1'000 USD	95.56%	843'998.37	0.39	a)
U586562MCE84	1.7100 % SUMIBK 1.71 01/12/31	0	1'000	0	1'000 USD	76.92%	679'360.57	0.31	a)
U586562MCS70	5.7660 % SUMIBK 5.766 01/13/33	0	1'000	0	1'000 USD	101.18%	893'637.02	0.41	a)
USJ57160DY66	4.3450 % NSANY 4.345 09/17/27 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52328980979	0.0100 % ASABRE 0.01 04/19/24	0	600	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52459747874	1.8500 % EJRAIL 1.85 04/13/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	83.96%	804'862.23	0.37	a)
X52489982293	3.5560 % MUFG 3.556 06/15/32 EMTN	0	900	0	900 EUR	96.19%	829'875.95	0.38	a)
X52589713614	4.4160 % MIZUHO 4.416 05/20/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.24%	380'544.47	0.18	a)
JP							4'432'278.61	2.05	
U550064FAL85	4.1250 % KOREA 4 1/8 06/10/44	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52058731717	0.2500 % SHNHAN 0 1/4 10/16/24 GMTN	0	800	0	800 EUR	95.70%	733'940.33	0.34	a)
KR							733'940.33	0.34	
U501609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	1'000	0	1'000 USD	92.90%	820'503.92	0.38	a)
U588032XAN49	3.9750 % TENCNT 3.975 04/11/29 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	92.14%	813'817.72	0.38	a)
KY							1'634'321.64	0.76	
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	1'400	0	0	1'400 EUR	54.26%	728'259.45	0.34	a)
X51637162592	1.2000 % DHR 1.2 06/30/27	2'500	0	200	2'300 EUR	91.62%	2'020'053.79	0.93	a)
X51960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	1'000	400	200	1'200 EUR	78.88%	907'396.15	0.42	a)
X52286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	72.30%	1'247'639.51	0.58	a)
X52318745937	1.2620 % ISDB 1.262 03/31/26	4'000	0	3'200	800 USD	90.87%	642'115.68	0.30	a)
X52397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	63.10%	907'378.90	0.42	a)
LU							6'452'843.48	2.98	
U502364WAP05	6.1250 % AMXLMM 6 1/8 11/15/37	0	1'000	0	1'000 USD	104.32%	921'424.07	0.43	a)
U505969BAD55	5.3750 % BSMXB 5 3/8 04/17/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	98.87%	873'233.95	0.40	a)
U591086QAZ19	5.7500 % MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN	0	200	0	200 USD	87.60%	154'748.93	0.07	a)
U591087BAS97	4.4000 % MEX 4.4 02/12/52	0	400	0	400 USD	76.99%	272'019.80	0.13	a)
USP60694AF68	2.4310 % KCMA 2.431 07/01/31 REGS	0	1'150	0	1'150 USD	83.57%	848'861.99	0.39	a)
X51974394675	1.6250 % MEX 1 5/8 04/08/26	100	0	0	100 EUR	93.52%	89'652.71	0.04	a)
MX							3'159'941.45	1.46	
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	
US00084DAW02	2.4700 % ABNAV 2.47 12/13/29 144A	0	1'000	0	1'000 USD	84.28%	744'385.44	0.34	a)
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	0	700	0	700 USD	117.61%	727'140.86	0.34	a)
US25156PBB85	4.3750 % DT 4 3/8 06/21/28 144A	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	100	0	0	100 USD	90.99%	80'364.27	0.04	a)
US29278GAV05	4.2500 % ENELIM 4 1/4 06/15/25 144A	0	800	0	800 USD	97.25%	687'133.17	0.32	a)
US29278GAX60	5.0000 % ENELIM 5 06/15/32 144A	0	2'000	0	2'000 USD	93.52%	1'651'942.48	0.76	a)
US74977RDR21	4.6550 % RABOBK 4.655 08/22/28 144A	0	1'000	0	1'000 USD	96.04%	848'299.80	0.39	a)
US780641AH94	8.3750 % KPN 8 3/8 10/01/30	3'000	0	1'300	1'700 USD	113.75%	1'707'939.64	0.79	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US826200AD92	6.1250 % SIEGR 6 1/8 08/17/26 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	1'700	0	0	1'700 USD	94.64%	1'421'088.31	0.66	a)
XS0148579666	6.3750 % EOANGR 6 3/8 06/07/32 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	103.85%	1'743'516.90	0.81	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	96.54%	1'705'343.77	0.79	a)
XS1405780963	1.3750 % ASML 1 3/8 07/07/26	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1705553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	1'000	0	700	300 EUR	93.96%	270'214.91	0.12	a)
XS1901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	83.44%	799'848.56	0.37	a)
XS1910948675	4.1250 % VW 4 1/8 11/16/38	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2084050637	0.3750 % NNGRNV 0 3/8 02/26/25	0	1'000	0	1'000 EUR	94.66%	907'398.07	0.42	a)
XS2168629967	1.2500 % HEIANA 1 1/4 05/07/33 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2191362859	1.2500 % DLR 1 1/4 02/01/31	0	1'000	0	1'000 EUR	76.48%	733'194.51	0.34	a)
XS2258452478	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/18/29	1'500	0	0	1'500 EUR	82.92%	1'192'381.75	0.55	a)
NL							15'220'192.44	7.04	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	1'000	0	0	1'000 USD	124.39%	1'098'639.35	0.51	a)
PE							1'098'639.35	0.51	
US83051GAU22	1.4000 % SEB 1.4 11/19/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	91.13%	804'932.22	0.37	a)
US86959LAP85	5.5000 % SHBASS 5 1/2 06/15/28 144A	0	600	0	600 USD	98.56%	522'324.02	0.24	a)
US86960BAX01	3.9000 % SHBASS 3.9 11/20/23 BKNT	0	600	0	600 USD	99.59%	527'798.40	0.24	a)
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	0	800	0	800 USD	97.34%	687'832.70	0.32	a)
US87020PAV94	5.4720 % SWEDA 5.472 06/15/26 144A	0	800	0	800 USD	99.45%	702'734.90	0.32	a)
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	67.24%	644'606.85	0.30	a)
XS2343459074	0.6250 % NDASS 0 5/8 08/18/31 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	88.67%	1'360'037.81	0.63	a)
SE							5'250'266.90	2.43	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	800	0	0	800 USD	95.72%	676'378.72	0.31	a)
XS2080786150	1.2500 % TEMASE 1 1/4 11/20/49 GMTN	620	0	0	620 EUR	60.40%	358'972.64	0.17	a)
SG							1'035'351.36	0.48	
US00206RCQ39	4.7500 % T 4 3/4 05/15/46	0	500	0	500 USD	83.16%	367'250.93	0.17	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	0	500	0	500 USD	65.26%	288'186.81	0.13	a)
US00287YAR09	4.5000 % ABBV 4 1/2 05/14/35	0	1'000	0	1'000 USD	94.07%	830'846.78	0.38	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBF92	5.9500 % MO 5.95 02/14/49	0	500	0	500 USD	93.00%	410'693.59	0.19	a)
US023135BT22	2.5000 % AMZN 2 1/2 06/03/50	2'000	0	0	2'000 USD	63.67%	1'124'659.89	0.52	a)
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	0	1'000	0	1'000 USD	83.40%	736'648.17	0.34	a)
US02665WDW82	2.0000 % HND 2 03/24/28 MTN	2'000	0	1'000	1'000 USD	87.49%	772'781.92	0.36	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	95.00%	83'905.22	0.04	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	100	0	0	100 USD	85.25%	75'293.53	0.03	a)
US031162CR97	3.1500 % AMGN 3.15 02/21/40	0	1'000	0	1'000 USD	74.58%	658'727.85	0.30	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	0	800	0	800 USD	99.14%	700'487.91	0.32	a)
US03522AAJ97	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	0	1'500	0	1'500 USD	92.95%	1'231'431.57	0.57	a)
US035240AG57	4.9500 % ABIBB 4.95 01/15/42	100	0	0	100 USD	95.30%	84'171.96	0.04	a)
US036752AC75	3.3500 % ELV 3.35 12/01/24	0	1'000	0	1'000 USD	97.28%	859'216.77	0.40	a)
US036752AG89	4.1010 % ELV 4.101 03/01/28	100	500	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	900	0	0	900 USD	84.50%	671'687.78	0.31	a)
US037833DZ01	2.4000 % AAPL 2.4 08/20/50	2'000	0	0	2'000 USD	64.25%	1'134'958.59	0.52	a)
US037833EA41	2.5500 % AAPL 2.55 08/20/60	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	0	1'000	350	650 USD	64.42%	369'854.75	0.17	a)
US04686E2U56	2.5500 % ATH 2.55 11/19/30 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05526DBG97	2.7890 % BATSLN 2.789 09/06/24	0	500	0	500 USD	97.02%	428'460.16	0.20	a)
US05565EBE41	3.9500 % BMW 3.95 08/14/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	95.58%	844'228.02	0.39	a)
US05723KAG58	3.1380 % BHI 3.138 11/07/29	0	1'000	0	1'000 USD	88.91%	785'306.41	0.36	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	2'000	0	200	1'800 USD	91.65%	1'457'081.63	0.67	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	2'000	0	1'000	1'000 USD	84.02%	742'097.82	0.34	a)
US07177MAB90	4.0000 % TACHEM 4 06/23/25	0	1'000	0	1'000 USD	97.24%	858'881.13	0.40	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	80.13%	1'415'461.12	0.65	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	500	0	0	500 USD	82.25%	363'232.15	0.17	a)
US110122DX32	3.9000 % BMY 3.9 03/15/62	0	1'000	0	1'000 USD	75.78%	669'344.52	0.31	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	100	0	0	100 USD	71.42%	63'084.36	0.03	a)
US114259AW41	4.8660 % NGGLN 4.866 08/05/32 144A	0	270	0	270 USD	92.13%	219'706.94	0.10	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	106.64%	753'489.98	0.35	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	0	900	0	900 USD	87.81%	698'023.64	0.32	a)
US161175CA05	3.9000 % CHTR 3.9 06/01/52	160	0	0	160 USD	63.83%	90'207.38	0.04	a)
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	1'800	0	0	1'800 USD	95.59%	1'519'753.51	0.70	a)
US177376AE06	4.5000 % CTXS 4 1/2 12/01/27	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NBQ34	4.6000 % CMCSA 4.6 08/15/45	2'000	0	350	1'650 USD	87.63%	1'277'057.61	0.59	a)
US24703TAB26	4.0000 % DELL 4 07/15/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US254687FY73	3.5000 % DIS 3 1/2 05/13/40	0	1'500	0	1'500 USD	80.11%	1'061'291.12	0.49	a)
US260543BJ10	7.3750 % DOW 7 3/8 11/01/29	2'000	0	0	2'000 USD	109.69%	1'937'620.86	0.90	a)
US26078JAD28	4.7250 % DD 4.725 11/15/28	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AX15	1.4000 % EBAY 1.4 05/10/26	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278NAP87	2.9000 % ET 2.9 05/15/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8H84	3.8500 % META 3.85 08/15/32	0	2'000	1'000	1'000 USD	91.76%	810'505.53	0.37	a)
US30303M8Q83	5.6000 % META 5.6 05/15/53	0	800	0	800 USD	100.34%	709'009.51	0.33	a)
US31428XBF24	3.2500 % FDX 3 1/4 04/01/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	2'000	0	1'000	1'000 USD	97.00%	856'743.67	0.40	a)
US37045XDD57	1.2500 % GM 1 1/4 01/08/26	3'000	0	0	3'000 USD	89.82%	2'380'111.44	1.10	a)
US375558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	1'100	0	0	1'100 USD	102.05%	991'531.15	0.46	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	500	1'500 USD	98.46%	1'304'458.68	0.60	a)
US42824CAW91	4.9000 % HPE 4.9 10/15/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CBN20	1.8000 % HYNMTR 1.8 10/15/25 REGS	3'000	0	2'000	1'000 USD	92.16%	814'012.03	0.38	a)
US458140BV11	2.8000 % INTC 2.8 08/12/41	0	1'000	0	1'000 USD	69.31%	612'207.07	0.28	a)
US458140BY59	3.7500 % INTC 3 3/4 08/05/27	1'300	0	0	1'300 USD	95.58%	1'097'416.04	0.51	a)
US459506AN18	1.2300 % IFF 1.23 10/01/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	89.60%	791'400.83	0.37	a)
US46647PAV85	4.2030 % JPM 4.203 07/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	94.42%	833'973.48	0.39	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	1'700	700	200	2'200 USD	83.04%	1'613'533.47	0.75	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	0	1'000	0	1'000 USD	88.40%	780'748.84	0.36	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	0	2'000	0	2'000 USD	97.08%	1'714'829.88	0.79	a)
US571903BD44	5.7500 % MAR 5 3/4 05/01/25 EE	0	500	0	500 USD	100.17%	442'371.35	0.20	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	800	0	0	800 USD	81.57%	576'338.29	0.27	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	1'750	0	300	1'450 USD	99.56%	1'275'038.94	0.59	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	900	0	300	600 USD	83.59%	442'958.71	0.20	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	4'750	0	2'600	2'150 USD	70.88%	1'345'945.37	0.62	a)
US595112BN22	5.3270 % MU 5.327 02/06/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BV48	6.7500 % MU 6 3/4 11/01/29	0	1'300	0	1'300 USD	103.99%	1'194'027.70	0.55	a)
US609207AY17	1.8750 % MDLZ 1 7/8 10/15/32	200	0	0	200 USD	77.18%	136'334.94	0.06	a)
US615369AE53	5.2500 % MCO 5 1/4 07/15/44	700	0	0	700 USD	96.00%	593'550.18	0.27	a)
US615369AP01	4.2500 % MCO 4 1/4 02/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	96.30%	850'605.08	0.39	a)
US61746BEF94	3.6250 % MS 3 5/8 01/20/27	1'264	0	0	1'264 USD	94.47%	1'054'633.71	0.49	a)
US61746BEG77	4.3750 % MS 4 3/8 01/22/47	0	700	0	700 USD	85.55%	528'928.08	0.24	a)
US63111XAE13	2.5000 % NDAQ 2 1/2 12/21/40	2'500	0	250	2'250 USD	65.73%	1'306'300.25	0.60	a)
US641062AL84	3.9000 % NESNVX 3.9 09/24/38 144A	3'000	0	1'500	1'500 USD	88.48%	1'172'183.16	0.54	a)
US641062BG80	4.9500 % NESNVX 4.95 03/14/30 144A	0	850	0	850 USD	100.73%	756'250.57	0.35	a)
US65339KCH14	4.6250 % NEE 4 5/8 07/15/27	0	1'000	0	1'000 USD	97.50%	861'159.92	0.40	a)
US65364UAL08	4.2780 % NGGLN 4.278 12/15/28 144A	0	1'000	0	1'000 USD	93.77%	828'250.02	0.38	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	1'000	0	0	1'000 USD	90.91%	802'997.91	0.37	a)
US66989HAR93	2.2000 % NOVNVX 2.2 08/14/30	3'000	0	400	2'600 USD	85.20%	1'956'529.47	0.90	a)
US68389XBQ79	4.0000 % ORCL 4 11/15/47	0	400	0	400 USD	74.59%	263'515.87	0.12	a)
US68389XBY04	3.8500 % ORCL 3.85 04/01/60	0	200	0	200 USD	67.77%	119'717.47	0.06	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	100	0	0	100 USD	88.00%	77'722.47	0.04	a)
US70450YAN31	5.2500 % PYPL 5 1/4 06/01/62	0	500	0	500 USD	95.17%	420'285.68	0.19	a)
US717081EZ22	2.5500 % PFE 2.55 05/28/40	0	1'000	0	1'000 USD	71.46%	631'170.45	0.29	a)
US718172BL29	4.2500 % PM 4 1/4 11/10/44	0	1'200	0	1'200 USD	80.90%	857'459.10	0.40	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	2'700	0	0	2'700 USD	81.99%	1'955'229.33	0.90	a)
US74368CBL72	3.2180 % PL 3.218 03/28/25 144A	0	800	0	800 USD	95.91%	677'692.99	0.31	a)
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	800	0	0	800 USD	84.85%	599'571.30	0.28	a)
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	0	1'000	0	1'000 USD	90.69%	801'037.09	0.37	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US771196BY74	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 144A	0	1'000	0	1'000 USD	64.55%	570'120.21	0.26	a)
US806851AJ09	3.7500 % SLB 3 3/4 05/01/24 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US828807DQ71	2.2500 % SPG 2 1/4 01/15/32	0	1'000	0	1'000 USD	77.38%	683'476.52	0.32	a)
US842400FP31	5.5000 % EIX 5 1/2 03/15/40	1'000	0	30	970 USD	96.53%	827'040.32	0.38	a)
US842434CY66	5.7500 % SRE 5 3/4 06/01/53	0	500	0	500 USD	98.94%	436'952.61	0.20	a)
US845011AC92	2.2000 % SWX 2.2 06/15/30	0	1'000	0	1'000 USD	80.84%	714'054.63	0.33	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	100	0	0	100 USD	94.70%	83'643.78	0.04	a)
US87264ACX19	5.8000 % TMUS 5.8 09/15/62	0	1'000	0	1'000 USD	96.95%	856'319.71	0.40	a)
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	800	600	0	1'400 USD	76.90%	950'956.41	0.44	a)
US89236THP30	0.8000 % TOYOTA 0.8 10/16/25 MTN	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US911312AJ59	6.2000 % UPS 6.2 01/15/38	500	0	0	500 USD	111.71%	493'321.62	0.23	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	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VCV45	4.2720 % VZ 4.272 01/15/36	100	0	0	100 USD	88.75%	78'386.67	0.04	a)
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	50	0	0	50 USD	66.57%	29'398.53	0.01	a)
US92343VGH15	2.1000 % VZ 2.1 03/22/28	0	1'000	0	1'000 USD	87.39%	771'889.84	0.36	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	800	0	0	800 USD	90.40%	638'773.47	0.30	a)
US92826CAK80	2.7000 % V 2.7 04/15/40	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	2'000	0	0	2'000 USD	59.15%	1'044'796.43	0.48	a)
US92928QAF54	3.5000 % ULFP 3 1/2 06/15/29 144A	0	1'000	0	1'000 USD	81.91%	723'487.74	0.33	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	0	1'200	0	1'200 USD	95.82%	1'015'596.18	0.47	a)
USU74078CG62	1.0000 % NESNVX 1 09/15/27 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0252367775	5.0000 % AIG 5 04/26/23 EMTN	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	101'000	0	0	101'000 JPY	106.19%	650'655.91	0.30	a)
XS0785710046	4.8750 % T 4 7/8 06/01/44	0	500	0	500 GBP	81.73%	457'387.65	0.21	a)
XS1001749289	3.1250 % MSFT 3 1/8 12/06/28	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1412266907	1.6500 % JNJ 1.65 05/20/35	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1421915049	1.5000 % MMM 1 1/2 06/02/31 MTN	0	680	0	680 EUR	83.74%	545'872.20	0.25	a)
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	89.79%	1'291'183.69	0.60	a)
XS1499602289	1.0000 % BX 1 10/05/26 REGS	0	1'000	0	1'000 EUR	91.14%	873'711.56	0.40	a)
XS1612543121	1.5000 % GE 1 1/2 05/17/29	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1627602201	1.8750 % AIG 1 7/8 06/21/27	2'000	0	150	1'850 EUR	92.50%	1'640'485.69	0.76	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	100	0	0	100 EUR	92.90%	89'052.61	0.04	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	100	0	0	100 EUR	90.75%	86'995.37	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	82.13%	708'587.25	0.33	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	100	0	0	100 EUR	68.81%	65'965.75	0.03	a)
XS2052321093	1.5000 % VZ 1 1/2 09/19/39	0	1'000	0	1'000 EUR	67.57%	647'760.76	0.30	a)
XS2058557260	1.5000 % TMO 1 1/2 10/01/39 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	69.29%	664'220.56	0.31	a)
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	1'000	0	0	1'000 EUR	89.40%	856'983.34	0.40	a)
XS2091604715	0.3000 % CB 0.3 12/15/24	0	1'400	0	1'400 EUR	95.22%	1'277'899.86	0.59	a)
XS2091606330	0.8750 % CB 0 7/8 12/15/29	0	500	0	500 EUR	83.37%	399'593.55	0.18	a)
XS2115092012	1.2000 % IBM 1.2 02/11/40	0	700	0	700 EUR	65.87%	441'997.91	0.20	a)
XS2168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	3'250	0	2'300	950 EUR	87.91%	800'564.66	0.37	a)
XS2251337601	1.8750 % VZ 1 7/8 11/03/38	0	400	0	400 GBP	58.99%	264'088.85	0.12	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	0	500	0	500 EUR	73.00%	349'921.76	0.16	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 % HNDA 0.3 07/07/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	1'500	0	200	1'300 EUR	77.91%	970'949.01	0.45	a)
XS2464407860	2.5000 % NESNVX 2 1/2 04/04/32 EMTN	1'000	0	400	600 GBP	83.02%	557'487.57	0.26	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	98.63%	945'484.73	0.44	a)
XS2621007660	4.1250 % BKNG 4 1/8 05/12/33	0	500	0	500 EUR	100.12%	479'893.80	0.22	a)
XS2625194811	4.6250 % PLD 4 5/8 05/23/33	0	400	0	400 EUR	98.97%	379'497.64	0.18	a)
US							88'787'875.75	41.05	
US045167FM03	2.8750 % ASIA 2 7/8 05/06/25 GMTN	1'000	0	400	600 USD	96.49%	511'322.26	0.24	a)
US458182BV36	7.0000 % IADB 7 06/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	102.89%	908'731.76	0.42	a)
US4581X0CE61	4.3750 % IADB 4 3/8 01/24/44	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45905CAA27	4.7500 % IBRD 4 3/4 02/15/35 GMTN	4'800	0	4'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	3'000	0	0	3'000 USD	95.90%	2'541'136.75	1.17	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	740	0	0	740 USD	80.83%	528'276.24	0.24	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	2'000	0	2'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1505567088	0.8750 % EIB 0 7/8 09/13/47 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	60.31%	636'011.70	0.29	a)
XS2055744689	0.1500 % EUROF 0.15 10/10/34 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	71.69%	1'030'913.68	0.48	a)
XS2182121827	1.6250 % CAF 1 5/8 06/03/25	0	1'000	0	1'000 EUR	95.56%	916'044.98	0.42	a)
XS							7'072'437.37	3.27	

Derivative Finanzinstrumente

-2'436'292.89 -1.13

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
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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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	
	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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		6'524'313	6'575'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		596'230	869'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		262'062	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		298'224	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		16'836'991	18'030'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		80'000	80'102		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		200'000	187'724		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		241'626	260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		150'000	140'699		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		275'053	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		68'672	70'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		318'318	350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		127'076	130'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		200'000	184'471		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		30'000	29'210		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		180'000	167'087		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		60'000	59'221		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		92'484	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		127'874	140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		88'832	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		82'395	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		59'238	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		200'000	184'110		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		30'000	29'952		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		200'000	183'837		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		70'000	69'724		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		6'592'869	6'655'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		16'506'856	18'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		1'211'592	1'076'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		584'599	869'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		288'641	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		261'515	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		50'000	49'631		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		586'099	650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		78'878	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		58'805	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		132'942	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		100'000	98'311		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		100'000	89'202		USD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		106'757	160'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		120'000	107'612		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		71'342	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		106'889	120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		130'000	116'518		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		88'669	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		88'635	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		1'206'936	1'076'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		16'856'625	18'990'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		6'504'810	6'645'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		251'271	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		285'348	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		684'117	1'029'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		400'000	355'150		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		60'000	58'766		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		62'210	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		87'671	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		116'004	130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		250'000	224'563		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		250'000	226'233		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		80'000	77'698		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		60'000	66'990		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		30'000	19'948		CAD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		249'292	38'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		279'053	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		6'414'277	6'595'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		16'651'801	18'290'000		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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GBP/CHF	Verfall 07.07.2023		1'147'325	1'016'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.07.2023		669'715	999'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		63'357	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 07.07.2023		40'000	45'409	GBP/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		72'290	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		58'252	60'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		89'203	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.07.2023		78'000	69'748	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		69'711	78'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.07.2023		4'450'000	27'787	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 07.07.2023		16'000	18'125	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.07.2023		100'000	89'703	USD/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.08.2023		209'037	33'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.08.2023		1'093'354	960'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		16'510'697	18'440'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.08.2023		674'418	999'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		6'488'059	6'655'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.08.2023		282'651	473'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		200'000	177'654	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.08.2023		100'000	97'381	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		211'244	240'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		129'822	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		96'331	100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		144'122	150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		300'157	350'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		69'143	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.08.2023		44'343	40'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.08.2023		15'079	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.08.2023		30'658	5'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		200'000	173'117	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		120'000	104'282	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.08.2023		70'000	66'880	EUR/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		1'111'290	1'000'000	CHF/GBP		-7'135.69	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023		670'831	1'022'000	CHF/CAD		4'055.47	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		6'423'601	6'735'000	CHF/EUR		-30'193.16	-0.01	b)
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023		235'888	38'600'000	CHF/JPY		1'628.36	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023		275'576	473'000	CHF/AUD		5'129.24	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		15'967'650	18'490'000	CHF/USD		-351'746.52	-0.16	b)
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		140'000	122'445	USD/CHF		1'120.83	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023		40'000	38'310	EUR/CHF		20.05	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 07.09.2023		50'000	55'502	GBP/CHF		419.76	0.00	b)
CHF/CAD	Verfall 07.09.2023		50'000	32'807	CAD/CHF		-185.71	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		220'000	193'047	USD/CHF		1'127.67	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		200'000	175'798	USD/CHF		724.64	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023		90'000	85'906	EUR/CHF		335.90	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		53'010	60'000	CHF/USD		53.36	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		175'203	200'000	CHF/USD		-1'319.06	0.00	b)
CHF/AUD	Verfall 07.09.2023		25'000	14'262	AUD/CHF		32.65	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023		3'700'000	22'280	JPY/CHF		175.12	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		120'000	105'998	USD/CHF		-84.53	0.00	b)
Klasse A hedged							-375'841.62	-0.17	
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	
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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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	
	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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		2'330'892	2'349'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		92'683	13'457'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		212'694	310'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		104'032	165'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		6'021'349	6'448'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		30'000	30'057	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		8'000	9'028	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		60'000	56'336	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		83'627	90'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		50'000	46'920	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		91'672	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		29'414	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		118'226	130'000	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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		43'968	45'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		80'000	73'804	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		50'000	46'434	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		35'000	34'558	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		36'975	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		63'922	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		23'859	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		29'591	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		32'024	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		19'726	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		80'000	73'659	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		20'000	19'978	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		5'999'432	6'593'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		2'390'472	2'413'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		431'264	383'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		208'545	310'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		100'689	165'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		92'489	13'457'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		60'000	54'589	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		30'000	29'791	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		225'423	250'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		34'492	35'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		50'000	44'766	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		26'564	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		30'000	26'782	USD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		40'015	60'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		30'000	29'514	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		50'000	44'856	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		35'000	34'324	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		35'656	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		35'610	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		50'000	44'833	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		26'580	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		24'487	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		35'436	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		6'020'984	6'783'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		2'327'831	2'378'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		88'866	13'457'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		429'607	383'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		99'540	165'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		245'990	370'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		150'000	133'184	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		30'000	29'398	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		26'644	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		38'948	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		40'135	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		90'000	80'856	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		70'000	63'363	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		30'000	29'155	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		20'000	22'350	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		15'000	9'989	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		60'000	54'261	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		88'166	13'457'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		5'906'883	6'488'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		2'293'384	2'358'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		97'344	165'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		409'920	363'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		237'987	355'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		36'191	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.07.2023		15'000	17'047	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		27'090	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		44'586	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		19'486	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.07.2023		1'457'000	9'118	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.07.2023		8'000	9'078	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.07.2023		18'000	16'171	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		74'656	12'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		387'229	340'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		5'900'515	6'590'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		239'658	355'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		2'318'348	2'378'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.08.2023		98'599	165'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.08.2023		35'000	34'103	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		80'000	71'077	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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		79'203	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		33'696	35'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		43'254	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		111'479	130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		48'021	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		25'910	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		12'245	2'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		6'539	10'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		18'829	17'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		60'000	51'955		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		52'096	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		19'070	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		239'582	365'000		CHF/CAD	1'448.38	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		396'731	357'000		CHF/GBP	-2'547.44	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		2'334'814	2'448'000		CHF/EUR	-10'974.43	-0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		96'131	165'000		CHF/AUD	1'789.27	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		85'555	14'000'000		CHF/JPY	590.59	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		5'803'278	6'720'000		CHF/USD	-127'838.65	-0.06	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		50'000	43'750		USD/CHF	380.80	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		15'000	16'671		GBP/CHF	104.94	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		15'000	14'385		EUR/CHF	-11.23	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		15'000	9'863		CAD/CHF	-76.70	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		80'000	70'214		USD/CHF	394.86	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		60'000	52'758		USD/CHF	198.20	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		30'000	28'656		EUR/CHF	91.87	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		44'170	50'000		CHF/USD	39.47	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		61'304	70'000		CHF/USD	-479.17	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		1'200'000	7'246		JPY/CHF	36.52	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		80'000	70'675		USD/CHF	-65.96	0.00	b)
Klasse B hedged							-136'918.68	-0.06	
	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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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	
	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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
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		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		3'789'490	4'058'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.04.2023		276'023	244'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.04.2023		66'202	105'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.04.2023		57'578	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.04.2023		132'419	193'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023		15'000	15'044	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		30'000	28'183	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		51'093	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		30'000	28'164	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		59'577	65'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		19'599	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		72'743	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		29'302	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		40'000	36'917	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		92'767	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		29'562	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		23'098	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		41'082	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		14'901	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		9'844	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		21'034	23'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		19'726	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		50'000	46'049	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023		15'000	14'991	EUR/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 10.05.2023		57'458	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 10.05.2023		1'557'324	1'572'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		3'913'781	4'301'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 10.05.2023		274'748	244'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 10.05.2023		64'075	105'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 10.05.2023		129'836	193'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		126'232	140'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 10.05.2023		14'765	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		44'294	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		20'000	17'864	USD/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 10.05.2023		35'343	53'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 10.05.2023		25'000	24'525	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		30'000	26'926	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		22'274	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		22'245	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		30'000	26'912	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		26'580	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 10.05.2023		13'311	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 10.05.2023		19'584	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		17'703	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		55'207	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		4'004'225	4'511'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		63'344	105'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		163'550	246'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		287'152	256'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		1'548'625	1'582'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.06.2023		100'000	88'799	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.06.2023		25'000	24'503	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		17'753	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		29'204	30'000	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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		26'747	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		60'000	53'914	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		50'000	45'268	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		10'000	6'669	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		15'000	16'770	GBP/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		4'093	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		25'000	24'301	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		272'151	241'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		3'961'290	4'351'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		158'211	236'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		66'076	112'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		1'519'197	1'562'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		54'772	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		27'136	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		19'441	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.07.2023		8'000	9'106	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		18'050	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		26'740	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		13'382	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		15'583	16'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.07.2023		26'000	23'345	USD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		159'322	236'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.08.2023		66'928	112'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		1'557'914	1'598'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		265'366	233'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		52'010	8'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		3'957'553	4'420'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		50'000	44'434	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.08.2023		30'000	29'235	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		52'792	60'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		28'878	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		34'597	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		68'591	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		28'800	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		25'910	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		7'735	7'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		6'108	1'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		5'882	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		40'000	34'647	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		34'720	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		19'070	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		65'253	112'000	CHF/AUD		1'214.54	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		57'200	9'360'000	CHF/JPY		394.86	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		3'920'667	4'540'000	CHF/USD		-86'367.18	-0.04	b)
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		1'571'803	1'648'000	CHF/EUR		-7'388.03	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		266'710	240'000	CHF/GBP		-1'712.57	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		160'816	245'000	CHF/CAD		972.21	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		50'000	43'750	USD/CHF		380.80	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		10'000	9'600	EUR/CHF		-17.48	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		10'000	11'124	GBP/CHF		59.95	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		10'000	6'585	CAD/CHF		-61.14	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		60'000	52'668	USD/CHF		288.35	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		40'000	35'182	USD/CHF		122.13	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		20'000	19'114	EUR/CHF		51.26	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		35'330	40'000	CHF/USD		25.58	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		43'780	50'000	CHF/USD		-350.76	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		800'000	4'841	JPY/CHF		14.35	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		20'000	17'691	USD/CHF		-39.08	0.00	b)
Klasse It hedged							-92'412.21	-0.04	
	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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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 11.10.2022		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	
	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	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	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	
	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	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		76'630'254	82'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		5'588'331	4'940'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		2'725'353	3'972'175		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		1'358'859	2'155'225		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'219'061	177'001'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		400'000	400'440		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		800'000	750'894		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		60'000	67'380		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'115'195	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		300'000	281'394		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'191'895	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		539'694	550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		488'769	500'000		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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		1'546'118	1'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.04.2023		30'861	50'775	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.04.2023		66'311	99'825	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		1'000'000	922'356	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		800'000	742'608	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023		500'000	493'355	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		462'473	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		822'076	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		348'318	350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		296'147	300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		457'826	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023		296'279	300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.04.2023		1'100'000	1'012'605	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023		200'000	199'517	EUR/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 10.05.2023		30'552'078	30'840'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		76'583'075	84'160'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 10.05.2023		2'739'340	4'072'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 10.05.2023		1'216'514	177'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 10.05.2023		1'346'176	2'206'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 10.05.2023		5'494'953	4'880'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		2'885'408	3'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 10.05.2023		295'846	300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		709'038	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		500'000	445'950	USD/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 10.05.2023		507'133	760'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 10.05.2023		400'000	392'007	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		450'000	403'515	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		356'784	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		445'406	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		500'000	448'123	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		532'085	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 10.05.2023		392'198	400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 10.05.2023		222'309	200'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		354'587	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		30'483'039	31'140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		5'698'175	5'080'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		3'212'492	4'832'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		78'655'375	88'610'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		1'168'862	177'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		1'330'818	2'206'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.06.2023		2'000'000	1'775'748	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.06.2023		500'000	489'568	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		355'587	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		487'128	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		535'433	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.06.2023		1'200'000	1'077'900	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.06.2023		150'000	167'393	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.06.2023		900'000	814'439	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.06.2023		300'000	291'311	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.06.2023		160'000	178'596	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.06.2023		160'000	106'257	CAD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		77'851'040	85'510'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.07.2023		3'132'039	4'672'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.07.2023		1'159'657	177'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.07.2023		5'386'556	4'770'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		29'994'891	30'840'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 07.07.2023		1'301'458	2'206'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		452'673	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 07.07.2023		190'000	215'594	GBP/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		316'341	350'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		291'355	300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		713'716	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.07.2023		19'001'000	118'549	JPY/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		195'125	200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		627'575	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		391'058	400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.08.2023		1'318'239	2'206'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		78'667'560	87'860'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.08.2023		982'970	158'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		30'943'802	31'740'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.08.2023		3'154'035	4'672'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.08.2023		5'216'208	4'580'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		1'000'000	888'268	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.08.2023		500'000	486'850	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. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		1'056'222	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		692'410	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		481'709	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		1'372'147	1'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		749'440	780'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		518'690	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		171'819	28'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		131'350	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		221'823	200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		900'000	779'028		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		238'701	250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		781'733	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		5'311'966	4'780'000		CHF/GBP	-34'108.60	-0.02	b)
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		3'197'932	4'872'000		CHF/CAD	19'332.93	0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		1'285'246	2'206'000		CHF/AUD	23'922.01	0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		31'254'846	32'770'000		CHF/EUR	-146'908.65	-0.07	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		77'601'568	89'860'000		CHF/USD	-1'709'461.44	-0.79	b)
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		1'136'665	186'000'000		CHF/JPY	7'846.51	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	524'744		USD/CHF	4'821.53	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		150'000	166'448		GBP/CHF	1'316.28	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		130'000	85'250		CAD/CHF	-434.77	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		200'000	191'437		EUR/CHF	212.21	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		900'000	789'737		USD/CHF	4'613.20	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	527'393		USD/CHF	2'173.93	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		210'000	200'419		EUR/CHF	813.16	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		530'293	600'000		CHF/USD	725.60	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		15'000'000	90'232		JPY/CHF	801.39	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		876'015	1'000'000		CHF/USD	-6'595.33	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		300'000	264'974		USD/CHF	-190.34	0.00	b)
Klasse Nt hedged							-1'831'120.38	-0.85	
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-2'436'292.89	-1.13	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'096'903.70	0.97
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	214'221'957.20	99.04
Derivative Finanzinstrumente	-2'436'292.89	-1.13
Sonstige Vermögenswerte	2'425'090.35	1.12
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	216'307'658.36	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-49'404.68	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	216'258'253.68	

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);	214'221'957.20	99.04
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'436'292.89	-1.13
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57203686
CAD	1 = CHF	0.65283270
EUR	1 = CHF	0.95863723
GBP	1 = CHF	1.11921024
JPY	100 = CHF	0.60669000
USD	1 = CHF	0.88325000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	4'224'140.66	1.953
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	163'849'918.93	75.766

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2022 - 31.08.2023

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 - 31.08.2023

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

Bloomberg Global Aggregate Credit Total Return Index Value unhedged CHF

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 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 05.12.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 08.12.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Ja	CHF	1.70000	0.59500	1.10500
A hedged	Ja	CHF	1.60000	0.56000	1.04000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 05.12.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 08.12.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Ja	CHF	1.861	0.651	1.210
B hedged	Ja	CHF	1.780	0.623	1.157
It	Ja	CHF	2.463	0.862	1.601
It hedged	Ja	CHF	2.322	0.812	1.510
Nt	Ja	CHF	2.840	0.994	1.846
Nt hedged	Ja	CHF	2.655	0.929	1.726

12 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.

13 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.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

BEKB Obligationenfonds

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

BEKB Obligationen CHF

BEKB Obligationen Global Staatsanleihen

BEKB Obligationen Global Unternehmensanleihen

BEKB Obligationen Nachhaltig CHF

BEKB Obligationen Nachhaltig Global

BEKB Obligationen CHF Short Duration

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, die Anlagepolitik im Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Die Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 3 Bst. ba des Fondsvertrages präzisiert werden.

In der erwähnten Bestimmung wird bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

Somit ist in § 8 Ziff. 3 Bst. ba neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Schuldverschreibungen, Pfandbriefe, ausgenommen sind Asset Backed Securities ABS) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderung des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 7. Juni 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich