



BEKB OBLIGATIONEN NACHHALTIG GLOBAL

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	36598207	CHF
B	36598206	CHF
It	36598204	CHF
Nt	36598209	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	16
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
7	Verwaltungskommission	17
8	Benchmark	17
9	TER	17
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	18
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	18
12	Fussnoten	18
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19
14	Pflichtpublikationen	21

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		185'382'956.90	230'434'901.81	215'580'792.48	162'790'986.60
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		880'789.48	979'947.13	1'174'486.97	926'437.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		11'455.467	11'992.467	12'038.000	9'266.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		76.89	81.71	97.56	99.98
Ausschüttung je Anteil		1.45	1.40	1.60	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'793'742.69	1'541'930.81	1'523'280.06	1'015'489.35
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		22'092.001	18'075.001	15'125.001	9'926.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		81.19	85.31	100.71	102.31
Thesaurierung je Anteil		1.50	1.46	1.53	1.53
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'395'647.89	5'604'880.37	6'664'475.27	6'169'801.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		63'737.807	63'237.807	63'926.653	58'478.779
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		84.65	88.63	104.25	105.50
Thesaurierung je Anteil		2.05	2.07	2.18	2.17
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
Klasse Nt	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		177'312'776.84	222'308'143.50	206'218'550.18	154'679'257.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'116'555.167	2'539'236.786	2'006'443.611	1'490'051.073
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		83.77	87.55	102.78	103.81
Thesaurierung je Anteil		2.28	2.33	2.45	2.44
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	-4.23 %	-16.69 %	-3.62 %	3.24 %
Klasse B	-4.24 %	-16.70 %	-3.62 %	3.24 %
Klasse It	-3.69 %	-16.23 %	-3.07 %	3.83 %
Klasse Nt	-3.41 %	-15.97 %	-2.78 %	4.14 %
Benchmark	-3.28 %	-13.65 %	-2.54 %	4.13 %
Tracking Error ³³⁾	0.68 %	1.32 %	0.43 %	1.15 %

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	-0.95 %
Klasse B	-0.96 %
Klasse It	-0.41 %
Klasse Nt	-0.13 %

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	4'110'774.24	6'659'691.40
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	180'857'892.64	221'676'008.95
Derivative Finanzinstrumente	-1'177'373.93	22'784.00
Sonstige Vermögenswerte	1'599'666.23	2'086'291.15
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	185'390'959.18	230'444'775.50
Andere Verbindlichkeiten	-8'002.28	-9'873.69
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	185'382'956.90	230'434'901.81

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'992.467	12'038.000
Ausgegebene Anteile		863.000	3'494.467
Zurückgenommene Anteile		-1'400.000	-3'540.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		11'455.467	11'992.467
Klasse B			
	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		18'075.001	15'125.001
Ausgegebene Anteile		4'917.000	3'815.000
Zurückgenommene Anteile		-900.000	-865.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		22'092.001	18'075.001
Klasse It			
	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		63'237.807	63'926.653
Ausgegebene Anteile		3'100.000	2'848.872
Zurückgenommene Anteile		-2'600.000	-3'537.718
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		63'737.807	63'237.807
Klasse Nt			
	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'539'236.786	2'006'443.611
Ausgegebene Anteile		490'351.811	810'083.777
Zurückgenommene Anteile		-913'033.430	-277'290.602
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'116'555.167	2'539'236.786

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		230'434'901.81	215'580'792.48
Ausbezahlte Ausschüttung		-15'648.45	-18'825.60
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'890'646.50	-1'920'416.74
Saldo aus dem Anteilverkehr		-35'626'770.82	51'806'289.39
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-7'518'879.14	-35'012'937.72
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		185'382'956.90	230'434'901.81

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		18'018.59	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-2'064.56	-34'433.51
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		5'062'718.57	5'721'046.44
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		522'809.85	1'009'014.48
Total Ertrag		5'601'482.45	6'695'627.41
Aufwand			
Passivzinsen		-216.74	-0.37
Reglementarische Vergütungen		-93'612.73	-109'941.91
Sonstige Aufwendungen		-10.40	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-493'151.40	-493'259.39
Total Aufwand		-586'991.27	-603'201.67
Nettoertrag / Verlust		5'014'491.18	6'092'425.74
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-15'773'290.09	-7'264'402.37
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		177'927.48	154'798.37
Realisierter Erfolg		-10'580'871.43	-1'017'178.26
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		3'061'992.29	-33'995'759.46
Gesamterfolg		-7'518'879.14	-35'012'937.72

Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	16'363.87	16'919.19
Vortrag des Vorjahres	269.43	139.69
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	16'633.30	17'058.88
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	16'610.43	16'789.45
Vortrag auf neue Rechnung	22.87	269.43
Total	16'633.30	17'058.88
Klasse B	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	33'247.72	26'540.17
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	33'247.72	26'540.17
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	11'636.70	9'289.06
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	21'611.02	17'251.11
Total	33'247.72	26'540.17
Klasse It	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	130'898.58	131'064.31
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	130'898.58	131'064.31
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	45'814.50	45'872.51
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	85'084.08	85'191.80
Total	130'898.58	131'064.31
Klasse Nt	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	4'833'981.01	5'917'902.07
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'833'981.01	5'917'902.07
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'691'893.35	2'071'265.72
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'142'087.66	3'846'636.35
Total	4'833'981.01	5'917'902.07

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							180'857'892.64	97.55	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							180'857'892.64	97.55	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	1'400	0	1'400 AUD	80.26%	642'739.47	0.35	a)
AU0000078552	1.5000 % TCV 1 1/2 11/20/30	0	2'000	0	2'000 AUD	82.22%	940'657.41	0.51	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'000	800	0	1'800 AUD	57.45%	591'491.83	0.32	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	2'500	0	2'500 AUD	79.29%	1'133'948.67	0.61	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	500	1'000	0	1'500 AUD	103.83%	890'875.90	0.48	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	1'400	500	400	1'500 AUD	101.23%	868'575.05	0.47	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	300	2'700	0	3'000 AUD	88.15%	1'512'699.99	0.82	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	200	1'800	0	2'000 AUD	79.37%	907'994.11	0.49	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	0	1'000	0	1'000 AUD	95.30%	545'156.85	0.29	a)
AU3CB0268126	2.2000 % CGJAU 2.2 11/06/26 MTN	0	500	0	500 AUD	92.43%	264'355.39	0.14	a)
AU3CB0271989	2.2500 % QTC 2 1/4 11/20/41	0	1'000	0	1'000 AUD	65.45%	374'375.24	0.20	a)
AU3CB0289817	3.9000 % NAB 3.9 05/30/25 MTN	0	475	0	475 AUD	98.72%	268'239.52	0.14	a)
AU3CB0293769	6.8600 % CBAAU 6.86 11/09/32 MTN	0	500	0	500 AUD	103.79%	296'844.23	0.16	a)
AU3CB0294502	4.9500 % NAB 4.95 11/25/27 MTN	0	500	0	500 AUD	100.66%	287'903.29	0.16	a)
AU3SG0000417	5.0000 % NSWTC 5 08/20/24 24	0	700	0	700 AUD	100.74%	403'384.95	0.22	a)
AU3SG0001647	4.2000 % QTC 4.2 02/20/47 47	0	1'000	0	1'000 AUD	85.93%	491'522.67	0.27	a)
AU3SG0001860	3.2500 % QTC 3 1/4 08/21/29	0	1'000	0	1'000 AUD	95.09%	543'972.73	0.29	a)
AU3SG0002223	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/42 MTN	0	500	0	500 AUD	63.61%	181'947.76	0.10	a)
AU3SG0002256	2.0000 % TCV 2 11/20/37 MTN	0	1'500	0	1'500 AUD	68.50%	587'750.71	0.32	a)
AU3SG0002264	2.4000 % TCV 2.4 08/18/50 MTN	0	500	0	500 AUD	58.62%	167'655.42	0.09	a)
AU3SG0002421	0.5000 % TCV 0 1/2 11/20/25 MTN	0	500	0	500 AUD	92.42%	264'343.95	0.14	a)
AU3SG0002504	2.2500 % TCV 2 1/4 09/15/33	0	1'000	0	1'000 AUD	80.16%	458'556.19	0.25	a)
AU3SG0002710	4.7500 % TCV 4 3/4 09/15/36 MTN	0	600	0	600 AUD	97.56%	334'861.23	0.18	a)
AU3SG0002793	4.2500 % WATC 4 1/4 07/20/33	0	500	0	500 AUD	97.96%	280'195.09	0.15	a)
AU3TB0000101	5.5000 % ACGB 5 1/2 04/21/23 133	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	1'000	1'600	0	2'600 AUD	99.23%	1'475'784.17	0.80	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	900	1'000	0	1'900 AUD	97.11%	1'055'502.96	0.57	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	1'600	1'000	0	2'600 AUD	99.00%	1'472'482.37	0.79	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	0	4'000	0	4'000 AUD	95.52%	2'185'684.20	1.18	a)
US556079AC52	3.6240 % MQGAU 3.624 06/03/30 144A	1'000	0	500	500 USD	83.70%	369'631.29	0.20	a)
US80622GAE44	4.3750 % SCGAU 4 3/8 05/28/30 144A	0	500	0	500 USD	93.02%	410'786.33	0.22	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	1'300	0	500	800 USD	96.00%	678'307.74	0.37	a)
XS2315784715	0.7500 % APAAU 0 3/4 03/15/29 EMTN	0	650	0	650 EUR	82.44%	513'701.58	0.28	a)
AU							21'401'928.29	11.54	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	500	0	0	500 EUR	111.29%	533'428.89	0.29	a)
BE0002830116	0.7500 % PROXBB 0 3/4 11/17/36 EMTN	0	500	0	500 EUR	66.94%	320'831.91	0.17	a)
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	83.23%	159'574.75	0.09	a)
BE							1'013'835.55	0.55	
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	0	400	0	400 CAD	74.24%	193'873.03	0.10	a)
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	2'000	5'600	7'600	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	0	2'000	0	2'000 CAD	98.16%	1'281'680.33	0.69	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	100	0	50	50 CAD	85.68%	27'967.03	0.02	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	950	0	900	50 CAD	96.01%	31'340.21	0.02	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	2'000	150	1'950	200 CAD	74.64%	97'448.34	0.05	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	1'300	0	1'250	50 CAD	69.19%	22'583.44	0.01	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	0	800	0	800 CAD	88.00%	459'573.33	0.25	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	1'500	0	1'450	50 CAD	113.81%	37'148.47	0.02	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	200	0	150	50 CAD	110.40%	36'036.37	0.02	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	800	300	750	350 CAD	115.31%	263'464.35	0.14	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	0	300	0	300 CAD	106.08%	207'765.31	0.11	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	800	0	750	50 CAD	100.32%	32'747.39	0.02	a)
CA44810ZAS98	4.8900 % HYDONE 4.89 03/13/37 MTN	500	0	0	500 CAD	99.35%	324'304.44	0.17	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.
CA448814JC89	2.1000 % QHEL 2.1 02/15/60 JR	0	250	0	250 CAD	59.99%	97'902.06	0.05	a)
CA47788ZAM38	2.8100 % DE 2.81 01/19/29	400	0	0	400 CAD	89.90%	234'753.42	0.13	a)
CA563469TM71	4.1000 % MP 4.1 03/05/41	0	800	0	800 CAD	94.11%	491'515.13	0.27	a)
CA563469LUX18	2.0500 % MP 2.05 06/02/31	0	100	0	100 CAD	85.24%	55'648.77	0.03	a)
CA68323ACC68	3.4500 % ONT 3.45 06/02/45	0	400	0	400 CAD	86.18%	225'034.04	0.12	a)
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	0	300	0	300 CAD	86.38%	169'178.98	0.09	a)
CA803854KJ60	2.2000 % SCDA 2.2 06/02/30	0	100	0	100 CAD	88.06%	57'491.06	0.03	a)
CA891145T792	3.2260 % TD 3.226 07/24/24 DPNT	0	300	0	300 CAD	98.08%	192'081.66	0.10	a)
US29250NAF24	4.0000 % ENBCN 4 10/01/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	1'200	0	700	500 USD	115.29%	509'153.88	0.27	a)
XS2027438899	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	54.70%	524'393.74	0.28	a)
CA							5'573'084.78	3.01	
CH0520042489	0.2500 % UBS 0 1/4 01/29/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	94.07%	1'082'159.55	0.58	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'000	0	1'000	1'000 EUR	90.72%	869'637.35	0.47	a)
US225401AC20	4.2820 % CS 4.282 01/09/28 144A	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
CH							1'951'796.90	1.05	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	100	500	0	600 EUR	92.53%	532'198.96	0.29	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	100	0	0	100 EUR	113.90%	109'186.86	0.06	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	3'100	200	2'800	500 EUR	120.48%	577'487.86	0.31	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	1'000	0	800	200 EUR	115.74%	221'903.43	0.12	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	700	100	500	300 EUR	120.87%	347'620.07	0.19	a)
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	0	500	0	500 EUR	90.43%	433'452.62	0.23	a)
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	0	300	0	300 USD	98.14%	260'043.82	0.14	a)
US500769JD71	1.7500 % KFW 1 3/4 09/14/29	2'500	0	2'000	500 USD	86.81%	383'383.50	0.21	a)
XS2035038731	1.8750 % NRWK 1 7/8 07/31/24 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2484327999	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 05/24/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE							2'865'277.12	1.55	
XS2046595836	0.5000 % DANBNK 0 1/2 08/27/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	500	0	0	500 GBP	86.26%	482'737.76	0.26	a)
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	3'000	0	2'500	500 USD	90.13%	398'049.86	0.21	a)
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 GBP	100.90%	2'258'521.50	1.22	a)
DK							3'139'309.12	1.69	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	3'300	7'000	6'300	4'000 EUR	102.44%	3'928'111.91	2.12	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	100	600	0	700 EUR	118.35%	794'203.14	0.43	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	100	600	0	700 EUR	84.48%	566'906.42	0.31	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	0	800	0	800 EUR	87.47%	670'800.65	0.36	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	0	500	0	500 EUR	105.47%	505'532.55	0.27	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	0	500	0	500 EUR	83.88%	402'028.49	0.22	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	100	500	0	600 EUR	66.85%	384'526.65	0.21	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	0	670	0	670 EUR	46.01%	295'496.95	0.16	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	0	900	0	900 EUR	64.01%	552'252.69	0.30	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	0	1'000	0	1'000 EUR	93.54%	896'747.61	0.48	a)
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	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAL96	1.8490 % SANTAN 1.849 03/25/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2297549391	0.5000 % CABKSM 0 1/2 02/09/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	0	200'000	0	200'000 JPY	99.51%	1'207'482.97	0.65	a)
XS2676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.53%	289'112.56	0.16	a)
ES							10'493'202.59	5.66	
XS2185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	500	0	0	500 EUR	93.27%	447'036.51	0.24	a)
FI							447'036.51	0.24	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	3'600	0	900	2'700 EUR	113.66%	2'941'885.10	1.59	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	1'400	0	900	500 EUR	115.77%	554'907.16	0.30	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	0	250	0	250 EUR	110.47%	264'751.64	0.14	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.
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	600	0	0	600 EUR	98.14%	564'483.95	0.30	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	1'600	500	1'000	1'100 EUR	91.89%	968'980.93	0.52	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	1'300	100	0	1'400 EUR	81.83%	1'098'233.98	0.59	a)
FR0013403441	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 02/15/24 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	500	0	0	500 EUR	86.71%	415'602.79	0.22	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	1'100	400	700	800 EUR	52.31%	401'170.51	0.22	a)
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	500	0	400	100 EUR	80.62%	77'289.17	0.04	a)
FR0014001EW8	0.0000 % ALOFP 0 01/11/29	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.70%	286'731.27	0.15	a)
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	0	100'000	0	100'000 JPY	99.49%	603'579.37	0.33	a)
US05581KAB70	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 144A	1'000	0	500	500 USD	99.22%	438'189.16	0.24	a)
US12802DAK28	3.3750 % CADES 3 3/8 03/20/24 144A	1'080	0	1'080	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	0	500	0	500 USD	95.19%	420'365.17	0.23	a)
US22535WAE75	3.7500 % ACAFP 3 3/4 04/24/23 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X50878743623	5.1250 % AXASA 5 1/8 07/04/43 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51046806821	3.3760 % CADES 3 3/8 03/20/24 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52306220190	0.0000 % ALDFP 0 02/23/24 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52451372499	1.2500 % ALDFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	0	800	0	800 EUR	93.24%	715'036.01	0.39	a)
FR							9'751'206.21	5.26	
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	0	500	0	500 AUD	97.73%	279'514.37	0.15	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	0	300	0	300 GBP	99.89%	335'393.73	0.18	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	800	60	500	360 GBP	100.05%	403'117.14	0.22	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	500	600	300	800 GBP	102.20%	915'066.29	0.49	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	800	0	400	400 GBP	98.94%	442'938.64	0.24	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	600	0	0	600 GBP	100.86%	677'301.27	0.37	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	950	0	950	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	2'300	0	1'300	1'000 GBP	55.19%	617'692.13	0.33	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	0	900	0	900 GBP	57.63%	580'500.78	0.31	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	0	500	0	500 GBP	93.68%	524'238.08	0.28	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	300	600	0	900 GBP	29.72%	299'366.35	0.16	a)
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	0	700	0	700 GBP	64.04%	501'743.07	0.27	a)
JP582667AJ57	0.6500 % LLOYDS 0.65 05/30/23 6	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	1'000	0	900	100 USD	121.77%	107'553.35	0.06	a)
US636274AE20	5.8090 % NGGLN 5.809 06/12/33	0	500	0	500 USD	100.29%	442'901.30	0.24	a)
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	1'000	0	500	500 USD	79.11%	349'387.20	0.19	a)
US92857WAB63	6.2500 % VOD 6 1/4 11/30/32	100	0	0	100 USD	104.64%	92'425.93	0.05	a)
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	100	0	0	100 USD	90.23%	79'694.76	0.04	a)
US92857WB223	5.7500 % VOD 5 3/4 02/10/63	0	500	0	500 USD	92.87%	410'132.72	0.22	a)
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	0	600	0	600 USD	100.41%	532'106.90	0.29	a)
X50097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51083226321	4.7500 % MRWLN 4 3/4 07/04/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51480699641	4.3000 % STANLN 4.3 02/19/27 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51517174626	1.0000 % LLOYDS 1 11/09/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51961843171	3.0000 % HSBC 3 07/22/28	1'000	0	300	700 GBP	88.19%	690'882.89	0.37	a)
X52044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	400	0	0	400 GBP	86.23%	386'042.47	0.21	a)
X52351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	0	100'000	0	100'000 JPY	97.04%	588'722.34	0.32	a)
X52659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	0	100	0	100 GBP	97.95%	109'626.64	0.06	a)
X52669894821	6.1250 % NWDIE 6 1/8 08/21/28 EMTN	0	400	0	400 GBP	100.52%	450'021.01	0.24	a)
GB							9'816'369.36	5.29	
X51041815116	4.6000 % RURAIL 4.6 03/06/23	1'500	0	1'500	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	0.91	a)
X51843437036	2.2000 % RURAIL 2.2 05/23/27	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	600	0	0	600 USD	77.81%	412'348.80	0.22	a)
IE							2'104'638.14	1.14	
IT0004898034	4.5000 % BTPS 4 1/2 05/01/23 10Y	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	0	2'000	0	2'000 EUR	96.14%	1'843'190.97	0.99	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	0	800	0	800 EUR	92.32%	708'041.79	0.38	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	1'600	1'200	800	2'000 EUR	86.14%	1'651'521.05	0.89	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	2'500	450	1'900	1'050 EUR	69.52%	699'726.57	0.38	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.
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	1'000	0	0	1'000 EUR	73.31%	702'815.30	0.38	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	1'900	2'500	1'300	3'100 EUR	93.07%	2'765'890.81	1.49	a)
US465410AH18	6.8750 % ITALY 6 7/8 09/27/23	1'500	0	0	1'500 USD	100.05%	1'325'590.43	0.72	a)
XS0986194883	4.0000 % ISPIM 4 10/30/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.80%	420'841.74	0.23	a)
IT							10'117'618.66	5.46	
US90351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	95.92%	847'231.07	0.46	a)
XS0383002291	5.2250 % HTHROW 5.225 02/15/23 REGS	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	1'500	0	500	1'000 EUR	94.76%	908'366.29	0.49	a)
JE							1'755'597.36	0.95	
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	0	270'000	0	270'000 JPY	99.18%	1'624'548.98	0.88	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	1'020'000	680'000	515'000	1'185'000 JPY	102.29%	7'354'126.61	3.97	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	0	155'000	0	155'000 JPY	104.52%	982'855.39	0.53	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	920'000	0	300'000	620'000 JPY	107.09%	4'028'166.79	2.17	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	700'000	0	400'000	300'000 JPY	111.31%	2'025'865.31	1.09	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	360'000	20'000	340'000	40'000 JPY	106.90%	259'427.92	0.14	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	0	70'000	0	70'000 JPY	94.94%	403'181.30	0.22	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	100'000	0	0	100'000 JPY	118.40%	718'314.89	0.39	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	330'000	255'000	230'000	355'000 JPY	112.16%	2'415'688.51	1.30	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	165'000	100'000	50'000	215'000 JPY	105.44%	1'375'289.79	0.74	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	220'000	70'000	70'000	220'000 JPY	113.75%	1'518'241.73	0.82	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	100'000	0	0	100'000 JPY	107.03%	649'309.97	0.35	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	0	55'000	0	55'000 JPY	80.12%	267'330.67	0.14	a)
XS2459747874	1.8500 % EJRAIL 1.85 04/13/33 EMTN	0	600	0	600 EUR	83.96%	482'917.34	0.26	a)
JP							24'105'265.20	13.00	
US88032XBD57	3.9400 % TENCNT 3.94 04/22/61 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	66.30%	585'612.42	0.32	a)
KY							585'612.42	0.32	
XS2013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	0	150	0	150 EUR	62.93%	90'483.37	0.05	a)
LT							90'483.37	0.05	
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	500	0	0	500 EUR	54.26%	260'092.66	0.14	a)
XS1960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	225	0	0	225 EUR	78.88%	170'136.78	0.09	a)
XS2286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	72.30%	69'313.31	0.04	a)
XS2397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	500	0	0	500 EUR	63.70%	305'325.96	0.16	a)
LU							804'868.71	0.43	
US02364WAJ45	6.3750 % AMXLMM 6 3/8 03/01/35	0	500	0	500 USD	107.76%	475'895.10	0.26	a)
MX							475'895.10	0.26	
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	0	500	0	500 AUD	93.54%	267'538.78	0.14	a)
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25156PBB85	4.3750 % DT 4 3/8 06/21/28 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780641AH94	8.3750 % KPN 8 3/8 10/01/30	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	1'500	0	1'000	500 USD	94.64%	417'967.15	0.23	a)
XS1026109204	4.0000 % FREGR 4 02/01/24 REGS	0	800	0	800 EUR	100.00%	766'894.45	0.41	a)
XS1261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	96.54%	852'671.89	0.46	a)
XS1346254573	2.8750 % ABNAV 2 7/8 01/18/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405780963	1.3750 % ASML 1 3/8 07/07/26	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1613121422	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 05/16/24 EMTN	1'000	0	850	150 EUR	97.88%	140'741.37	0.08	a)
XS1705553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	800	0	600	200 EUR	93.96%	180'143.27	0.10	a)
XS1901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	83.44%	799'848.56	0.43	a)
XS2014382845	0.8750 % ALLRNV 0 7/8 06/24/32 EMTN	2'000	0	1'000	1'000 EUR	81.44%	780'742.92	0.42	a)
XS2100729776	1.2500 % RABOBK 1 1/4 01/14/25 GMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2227050379	0.8750 % LUCSHI 0 7/8 09/08/32 EMTN	0	600	0	600 EUR	78.88%	453'726.84	0.24	a)
XS2498042584	3.3750 % NEGANV 3 3/8 07/11/34 EMTN	0	450	0	450 EUR	96.79%	417'517.67	0.23	a)
NL							5'077'792.90	2.74	
NZGOVDT423C0	5.5000 % NZGB 5 1/2 04/15/23 0423	1'100	0	1'100	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	600	0	0	600 NZD	95.85%	302'464.21	0.16	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	500	0	0	500 NZD	98.31%	258'513.91	0.14	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.
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	600	0	0	600 NZD	90.78%	286'454.46	0.15	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	0	400	0	400 NZD	77.83%	163'723.21	0.09	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	500	0	0	500 NZD	96.52%	253'819.66	0.14	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	0	400	0	400 NZD	94.45%	198'698.62	0.11	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	0	550	0	550 NZD	61.42%	177'675.87	0.10	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	1'000	0	600	400 NZD	65.69%	138'202.81	0.07	a)
NZ							1'779'552.75	0.96	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	200	0	0	200 USD	124.39%	219'727.87	0.12	a)
PE							219'727.87	0.12	
PTOTECOEO037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	0	250	0	250 EUR	53.37%	127'906.17	0.07	a)
PT							127'906.17	0.07	
US83051GAU22	1.4000 % SEB 1.4 11/19/25 144A	0	500	0	500 USD	91.13%	402'466.11	0.22	a)
US86959LAP85	5.5000 % SHBASS 5 1/2 06/15/28 144A	0	500	0	500 USD	98.56%	435'270.02	0.23	a)
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	0	400	0	400 USD	97.36%	343'965.81	0.19	a)
US87020PAV94	5.4720 % SWEDA 5.472 06/15/26 144A	0	400	0	400 USD	99.45%	351'367.45	0.19	a)
XS1195216707	0.7500 % STOCKL 0 3/4 02/26/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.73%	917'722.59	0.50	a)
XS2343459074	0.6250 % NDASS 0 5/8 08/18/31 EMTN	1'000	0	500	500 EUR	88.67%	425'011.82	0.23	a)
SE							2'875'803.80	1.55	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	500	0	0	500 USD	95.72%	422'736.70	0.23	a)
US716973AH54	5.3400 % PFE 5.34 05/19/63	0	1'000	0	1'000 USD	98.48%	869'798.10	0.47	a)
SG							1'292'534.80	0.70	
US002824BB55	2.9500 % ABT 2.95 03/15/25	0	800	0	800 USD	96.80%	684'002.93	0.37	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02665WDW82	2.0000 % HNDA 2 03/24/28 MTN	1'000	0	500	500 USD	87.49%	386'390.96	0.21	a)
US036752AG89	4.1010 % ELV 4.101 03/01/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	1'000	0	500	500 USD	86.53%	382'155.78	0.21	a)
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	700	0	0	700 USD	84.50%	522'423.83	0.28	a)
US037833EA41	2.5500 % AAPL 2.55 08/20/60	1'000	0	500	500 USD	62.86%	277'583.39	0.15	a)
US04686E2U56	2.5500 % ATH 2.55 11/19/30 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565EBK01	3.9000 % BMW 3.9 04/09/25 144A	0	500	0	500 USD	97.95%	432'589.35	0.23	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	1'000	0	500	500 USD	84.02%	371'048.91	0.20	a)
US08652BAB53	1.9500 % BBY 1.95 10/01/30	1'500	0	1'000	500 USD	80.13%	353'865.28	0.19	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	100	0	0	100 USD	82.25%	72'646.43	0.04	a)
US125523CB40	3.4000 % CI 3.4 03/01/27	970	0	970	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14913Q3B33	2.1500 % CAT 2.15 11/08/24 MTN	0	800	0	800 USD	96.28%	680'321.55	0.37	a)
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	100	0	0	100 USD	95.59%	84'430.75	0.05	a)
US177376AE06	4.5000 % CTXS 4 1/2 12/01/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703TAB26	4.0000 % DELL 4 07/15/24	1'500	0	500	1'000 USD	98.44%	869'462.47	0.47	a)
US278642AX15	1.4000 % EBAY 1.4 05/10/26	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642BB85	6.3000 % EBAY 6.3 11/22/32	0	800	0	800 USD	105.38%	744'615.08	0.40	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	1'500	0	1'000	500 USD	97.00%	428'371.83	0.23	a)
US37045XAS53	4.0000 % GM 4 01/15/25	0	800	0	800 USD	97.22%	686'928.26	0.37	a)
US37558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	800	0	0	800 USD	102.05%	721'113.56	0.39	a)
US42824CAW91	4.9000 % HPE 4.9 10/15/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140BY59	3.7500 % INTC 3 3/4 08/05/27	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	0	800	0	800 USD	99.83%	705'377.58	0.38	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	1'500	0	700	800 USD	83.04%	586'739.44	0.32	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	600	0	0	600 USD	81.57%	432'253.72	0.23	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	500	0	0	500 USD	99.56%	439'668.60	0.24	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	700	0	500	200 USD	83.59%	147'652.90	0.08	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	2'000	0	0	2'000 USD	70.88%	1'252'042.21	0.68	a)
US595112BN22	5.3270 % MU 5.327 02/06/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BV48	6.7500 % MU 6 3/4 11/01/29	0	500	0	500 USD	103.99%	459'241.42	0.25	a)
US615369AE53	5.2500 % MCO 5 1/4 07/15/44	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	300	0	0	300 USD	90.91%	240'899.37	0.13	a)
US66989HAR93	2.2000 % NOVNVX 2.2 08/14/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	2'100	0	1'500	600 USD	88.00%	466'334.80	0.25	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	1'000	0	0	1'000 USD	81.99%	724'159.01	0.39	a)
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	0	800	0	800 USD	90.69%	640'829.67	0.35	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.
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	1'400	0	600	800 USD	76.90%	543'403.66	0.29	a)
US89236THP30	0.8000 % TOYOTA 0.8 10/16/25 MTN	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	1'000	0	800	200 USD	66.57%	117'594.14	0.06	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	600	0	0	600 USD	90.40%	479'080.10	0.26	a)
US92826CAK80	2.7000 % V 2.7 04/15/40	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	59.15%	522'398.21	0.28	a)
US92928QAF54	3.5000 % ULFP 3 1/2 06/15/29 144A	0	500	0	500 USD	81.91%	361'743.87	0.20	a)
US95000U2Z51	4.6110 % WFC 4.611 04/25/53 MTN	0	1'000	0	1'000 USD	84.56%	746'849.70	0.40	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	0	700	0	700 USD	95.82%	592'431.11	0.32	a)
XS1405775708	0.7500 % TMO 0 3/4 09/12/24	0	800	0	800 EUR	96.78%	742'199.95	0.40	a)
XS1434170426	1.2500 % SYY 1 1/4 06/23/23	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.79%	86'078.91	0.05	a)
XS1520899532	1.3750 % ABBV 1 3/8 05/17/24	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1718480327	0.3750 % UPS 0 3/8 11/15/23	0	800	0	800 EUR	99.30%	761'526.08	0.41	a)
XS1835955474	1.8120 % JPM 1.812 06/12/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	90.20%	864'662.02	0.47	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	100	0	0	100 EUR	92.90%	89'052.61	0.05	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	100	0	0	100 EUR	90.75%	86'995.37	0.05	a)
XS1914485534	1.1250 % SYK 1 1/8 11/30/23	0	800	0	800 EUR	99.31%	761'618.11	0.41	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2075937370	0.6250 % LLY 0 5/8 11/01/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	500	0	0	500 EUR	89.40%	428'491.67	0.23	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	0	300	0	300 EUR	73.00%	209'953.06	0.11	a)
XS2363117321	0.3000 % HNDA 0.3 07/07/28	1'000	0	0	1'000 EUR	85.32%	817'890.11	0.44	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	77.91%	224'065.16	0.12	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	98.63%	945'484.73	0.51	a)
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	0	100'000	0	100'000 JPY	99.77%	605'276.41	0.33	a)
US							23'779'944.06	12.83	
AU3CB0258598	3.3500 % EUROF 3.35 05/21/29 MTN	0	500	0	500 AUD	92.99%	265'957.10	0.14	a)
AU3CB0271914	1.5000 % IFC 1 1/2 04/15/35 MTN	0	500	0	500 AUD	69.04%	197'461.40	0.11	a)
EU000A1U9928	1.6250 % ESM 1 5/8 11/17/36 EMTN	400	0	0	400 EUR	82.65%	316'921.63	0.17	a)
US045167CW12	2.0000 % ASIA 2 01/22/25 GMTN	4'000	0	1'500	2'500 USD	95.74%	2'113'992.63	1.14	a)
US4581X0BX51	3.2000 % IADB 3.2 08/07/42	0	14'900	0	14'900 USD	81.64%	10'744'697.39	5.80	a)
US4581X0CE61	4.3750 % IADB 4 3/8 01/24/44	6'500	7'100	11'000	2'600 USD	95.80%	2'199'976.14	1.19	a)
US4581X0CY26	2.3750 % IADB 2 3/8 07/07/27	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0DG01	2.2500 % IADB 2 1/4 06/18/29	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0DS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	8'000	0	7'300	700 USD	80.09%	495'201.18	0.27	a)
US4581X0DZ81	0.5000 % IADB 0 1/2 09/23/24	2'700	9'500	6'200	6'000 USD	94.98%	5'033'677.08	2.72	a)
US4581X0EB05	1.5000 % IADB 1 1/2 01/13/27	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	0	4'000	0	4'000 USD	93.98%	3'320'384.06	1.79	a)
US459058EP48	2.5000 % IBRD 2 1/2 07/29/25 GDIF	4'300	8'000	5'300	7'000 USD	95.63%	5'912'316.52	3.19	a)
US459058FT50	1.8750 % IBRD 1 7/8 10/27/26 GDIF	11'000	0	10'000	1'000 USD	92.13%	813'747.06	0.44	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	3'000	0	1'500	1'500 USD	93.04%	1'232'703.45	0.66	a)
US459058KT95	3.5000 % IBRD 3 1/2 07/12/28	0	4'700	0	4'700 USD	96.20%	3'993'402.01	2.15	a)
US45905CAA27	4.7500 % IBRD 4 3/4 02/15/35 GMTN	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45950KDA51	3.6250 % IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN	0	8'000	6'000	2'000 USD	97.60%	1'724'121.67	0.93	a)
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	1'000	0	0	1'000 USD	95.90%	847'045.58	0.46	a)
XS1837142790	0.7500 % CAF 0 3/4 06/13/23 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS							39'211'604.90	21.15	
Derivative Finanzinstrumente							-1'177'373.93	-0.64	
Devisentermingeschäfte									
CAD/CHF	Verfall 11.10.2022		8'870'006	11'943'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 11.10.2022		2'489'745	4'175'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.10.2022		5'231'922	7'840'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		111'174'997	114'270'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.10.2022		12'603'691	11'125'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		56'616'220	57'720'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.10.2022		32'840'900	4'665'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		1'200'000	1'167'762	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		500'000	491'140	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		250'000	283'258	GBP/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		400'000	391'308		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		400'000	390'758		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		600'000	587'823		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		500'000	482'734		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		200'000	222'432		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		650'000	622'843		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		40'000'000	269'382		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		2'200'000	2'157'401		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		1'000'000	952'718		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		500'000	534'782		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		250'000	266'454		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		1'200'000	1'176'838		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		700'000	661'644		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		180'000	189'731		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		639'233	650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		980'648	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		1'025'569	1'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		54'210'102	55'870'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		2'258'368	4'045'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		4'922'556	7'760'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		31'610'534	4'625'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		107'684'475	108'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		10'471'561	9'495'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		8'528'226	11'793'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		500'000	495'123		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		400'000	388'202		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		300'000	299'536		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		400'000	387'791		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		150'000	165'501		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		16'500'000	16'453'470		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		5'300'000	5'133'368		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		100'000	110'473		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		90'000	65'121		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		150'000	93'840		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		400'000	397'584		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		501'314	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		750'000	753'579		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		40'000'000	269'576		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		684'482	600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		300'000	219'268		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		740'161	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		495'978	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		8'339'926	11'403'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		11'315'597	9'845'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		4'857'973	7'610'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		30'872'089	4'585'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		49'665'151	50'270'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		91'339'976	91'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		2'345'133	4'045'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		1'200'000	1'212'948		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		339'095	300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		696'778	700'000		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		1'699'155	1'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		731'914	750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		715'155	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.12.2022		1'200'000	851'864		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		2'800'000	2'682'095		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		1'750'000	1'717'646		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.12.2022		400'000	451'676		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		150'000'000	1'014'024		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		86'108'713	90'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		48'002'835	49'020'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		2'383'294	4'045'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		4'839'770	7'610'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		7'140'263	10'203'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		11'018'866	9'745'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		30'275'971	4'435'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		654'375	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		702'720	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		492'030	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		466'450	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		16'000'000	14'777'744		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		8'700'000	8'566'612		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/JPY Verfall 06.01.2023		850'000'000	5'827'005		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.01.2023		2'000'000	2'292'256		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		2'100'000	1'432'893		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		1'300'000	826'973		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.01.2023		500'000	299'910		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		370'355	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		592'698	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		493'279	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		923'852	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		1'673'387	1'700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		188'024	277'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		60'000	37'013		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		600'000	556'617		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		500'000	492'907		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.01.2023		200'000	225'341		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		150'000	103'224		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		80'000	50'644		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		42'456'168	43'120'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		3'923'515	6'170'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		71'897'306	77'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		5'639'871	8'230'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		2'074'070	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		8'427'886	7'545'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		25'254'246	3'585'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		393'762	400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		463'340	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		557'307	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'203'633	4'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		4'400'000	4'069'780		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		3'207'584	3'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		828'072	1'200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		708'257	1'100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		494'180	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		200'000	200'502		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		3'000'000	3'009'951		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		4'363'281	6'700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		628'337	550'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		2'099'030	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		48'054'991	48'220'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		6'474'355	9'430'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		9'026'716	13'970'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		25'345'878	3'585'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		9'133'750	8'095'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		68'026'270	74'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		5'000'000	4'984'040		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		1'250'000	858'441		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		4'651'344	7'200'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		552'129	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		900'000	833'587		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		493'137	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		690'657	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		95'000	65'663		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		40'000	44'607		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		285'000	182'150		AUD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		1'908'072	3'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		500'000	462'658		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		200'000	185'403		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		100'000	68'726		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		150'000	166'868		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		65'000	41'332		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		400'000	371'781		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		200'000	197'636		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		2'079'819	2'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		150'000	169'069		GBP/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		45'962'919	46'320'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		68'048'338	72'870'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		2'051'084	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		5'478'596	7'985'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		8'772'774	7'755'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		15'018'391	23'820'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		24'691'006	3'585'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		400'000	400'440		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		100'000	112'501		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		200'000	187'724		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 04.04.2023		1'091'377	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		782'030	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		888'440	900'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		916'852	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		500'000	458'025		USD/CHF	0.00	0.00		
	NZD/CHF Verfall 10.05.2023		2'018'310	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		8'619'645	7'655'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		24'639'418	3'585'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		5'371'717	7'985'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		47'175'420	47'620'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		67'674'469	74'370'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		14'535'774	23'820'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		300'000	297'269		EUR/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		766'437	850'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		1'514'588	2'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		650'000	582'855		USD/CHF	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		434'038	65'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		734'140	1'100'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		500'000	490'007		EUR/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		588'297	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		443'405	500'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		1'998'685	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		6'040'044	9'085'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		66'636'486	75'070'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		8'586'522	7'655'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		46'419'580	47'420'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		24'103'505	3'650'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		15'878'119	26'320'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		533'381	600'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		1'320'800	200'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		1'803'348	3'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		779'404	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		669'465	600'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		300'000	176'741		AUD/CHF	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		25'224'045	3'850'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		46'898'627	48'220'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		68'892'389	75'670'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		6'090'448	9'085'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		17'120'726	29'020'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	NZD/CHF Verfall 07.07.2023		1'934'166	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		9'322'017	8'255'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		723'064	800'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		485'592	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		1'954'550	310'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		1'361'317	2'280'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 02.08.2023		18'703'941	31'300'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		47'497'859	48'720'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		25'880'733	4'160'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		6'133'220	9'085'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		9'401'702	8'255'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	NZD/CHF Verfall 02.08.2023		1'964'497	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		68'469'250	76'470'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 02.08.2023		410'729	700'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		2'161'210	2'500'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		46'467'382	48'720'000		CHF/EUR	-218'412.84	-0.12	b)	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		18'643'648	32'000'000		CHF/AUD	347'010.10	0.19	b)	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		68'197'150	78'970'000		CHF/USD	-1'502'294.35	-0.81	b)	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		9'173'699	8'255'000		CHF/GBP	-58'905.14	-0.03	b)	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		5'963'303	9'085'000		CHF/CAD	36'050.82	0.02	b)	
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		1'905'335	3'545'000		CHF/NZD	42'163.26	0.02	b)	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		25'422'176	4'160'000'000		CHF/JPY	175'491.73	0.09	b)	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		1'223'869	1'400'000		CHF/USD	-11'784.90	-0.01	b)	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		1'654'871	270'000'000		CHF/JPY	16'262.12	0.01	b)	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		2'048'447	3'600'000		CHF/AUD	-9'910.29	-0.01	b)	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		500'000	438'743		USD/CHF	2'562.89	0.00	b)	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		356'438	320'000		CHF/GBP	-1'458.08	0.00	b)	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		200'000	190'875		EUR/CHF	774.44	0.00	b)	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	527'393		USD/CHF	2'173.93	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		2'121'173	2'400'000		CHF/USD	2'902.38	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte								-1'177'373.93	-0.64	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	4'110'774.24	2.22
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	180'857'892.64	97.55
Derivative Finanzinstrumente	-1'177'373.93	-0.64
Sonstige Vermögenswerte	1'599'666.23	0.86
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	185'390'959.18	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-8'002.28	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	185'382'956.90	

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);	180'857'892.64	97.55
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'177'373.93	-0.64
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
NZD	1 = CHF	0.52593121
USD	1 = CHF	0.88325000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'163'302.45	0.628
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	184'444'926.60	99.494

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	-
B	CHF	0.15	-	0.15	-
It	CHF	0.15	-	0.15	-
Nt	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	-
B	0.900	1.000	-
It	0.330	0.600	-
Nt	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 Excluding Securitized Total Return Index hedged 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	1.45000	0.50750	0.94250

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	1.504	0.526	0.978
It	Ja	CHF	2.053	0.718	1.335
Nt	Ja	CHF	2.283	0.799	1.484

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: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

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