

# BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL UNTERNEHMENSANLEIHEN

Jahresbericht per 31.08.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
A	30461403	CHF
A hedged	30509115	CHF
B	30528085	CHF
B hedged	30528075	CHF
It	29117679	CHF
It hedged	29117711	CHF
Nt	29117780	CHF
Nt hedged	29117785	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 20.12.2024

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2024

## 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 2024, 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, dem Fondsvertrag sowie 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 Unvollständigkeiten, 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 2024, 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	31
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	31
7	Verwaltungskommission	32
8	Benchmark	32
9	TER	32
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	33
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	33
12	Fussnoten	33
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	34

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.09.2023	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020
	bis	31.08.2024	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		198'485'765.35	216'258'253.68	238'327'186.88	315'060'973.10
<b>Klasse A</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'413'293.60	13'801'334.16	16'592'397.12	21'865'916.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		166'667.000	188'334.000	204'241.000	224'584.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.48	73.28	81.24	97.36
Ausschüttung je Anteil		2.05	1.70	1.95	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
<b>Klasse A hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'307'220.32	24'626'422.14	28'736'778.31	41'562'184.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		312'852.090	334'839.090	368'122.818	431'485.627
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.50	73.55	78.06	96.32
Ausschüttung je Anteil		2.00	1.60	1.90	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
<b>Klasse B</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'044'042.23	6'670'569.23	7'840'057.52	10'402'760.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		72'452.613	82'522.613	88'967.000	99'898.252
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.42	80.83	88.12	104.13
Thesaurierung je Anteil		2.28	1.86	2.04	2.03
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
<b>Klasse B hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'253'760.62	9'011'003.79	10'397'685.27	18'565'109.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		99'151.047	111'169.895	122'838.000	179'947.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.24	81.06	84.65	103.17
Thesaurierung je Anteil		2.20	1.78	1.96	1.98
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
<b>Klasse It</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'040'192.56	3'514'163.25	3'394'278.18	4'346'122.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'044.679	41'114.679	36'553.534	39'755.534
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		88.53	85.47	92.86	109.32
Thesaurierung je Anteil		2.91	2.46	2.72	2.74
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
<b>Klasse It hedged</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'636'142.74	6'062'729.80	6'106'350.10	7'997'325.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		88'231.000	72'206.000	69'846.000	75'276.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		86.55	83.96	87.43	106.24
Thesaurierung je Anteil		2.77	2.32	2.57	2.64
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %



Klasse Nt	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	26'942'242.87	31'567'037.01	35'450'023.58	42'174'095.80
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	291'141.205	354'012.852	366'609.917	371'192.076
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	92.54	89.17	96.70	113.62
Thesaurierung je Anteil	3.32	2.84	3.14	3.18
Total Expense Ratio (TER)	0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

Klasse Nt hedged	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	111'848'870.41	121'004'994.30	129'809'616.80	168'147'458.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	1'268'618.580	1'418'252.686	1'465'545.213	1'567'074.702
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	88.17	85.32	88.57	107.30
Thesaurierung je Anteil	3.11	2.65	2.94	3.03
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

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	4.02 %	-0.93 %	-17.60 %	-1.38 %
Klasse A hedged	3.51 %	3.64 %	-18.87 %	-3.38 %
Klasse B	4.03 %	-0.92 %	-17.59 %	-1.38 %
Klasse B hedged	3.47 %	3.60 %	-18.87 %	-3.39 %
Klasse It	4.62 %	-0.35 %	-17.13 %	-0.82 %
Klasse It hedged	4.08 %	4.16 %	-18.49 %	-2.86 %
Klasse Nt	4.93 %	-0.07 %	-16.87 %	-0.52 %
Klasse Nt hedged	4.46 %	4.60 %	-18.12 %	-2.48 %
Benchmark Hedge	4.24 %	3.87 %	-16.79 %	-
Benchmark	4.94 %	-0.62 %	-15.68 %	-0.23 %
Tracking Error 33)	0.38 %	0.51 %	0.99 %	0.31 %

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	-0.92 %
Klasse A hedged	-0.73 %
Klasse B	-0.91 %
Klasse B hedged	-0.77 %
Klasse It	-0.32 %
Klasse It hedged	-0.16 %
Klasse Nt	-0.01 %
Klasse Nt hedged	0.22 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'072'244.20	2'096'903.70
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	193'507'320.23	214'221'957.20
Derivative Finanzinstrumente	1'778'517.87	-2'436'292.89
Sonstige Vermögenswerte	2'172'584.32	2'425'090.35
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>198'530'666.62</b>	<b>216'307'658.36</b>
Andere Verbindlichkeiten	-44'901.27	-49'404.68
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>198'485'765.35</b>	<b>216'258'253.68</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Klasse A</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		188'334.000	204'241.000
Ausgegebene Anteile		1'660.000	2'760.000
Zurückgenommene Anteile		-23'327.000	-18'667.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>166'667.000</b>	<b>188'334.000</b>
<b>Klasse A hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		334'839.090	368'122.818
Ausgegebene Anteile		7'553.000	3'873.000
Zurückgenommene Anteile		-29'540.000	-37'156.728
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>312'852.090</b>	<b>334'839.090</b>
<b>Klasse B</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		82'522.613	88'967.000
Ausgegebene Anteile		1'012.000	4'318.613
Zurückgenommene Anteile		-11'082.000	-10'763.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>72'452.613</b>	<b>82'522.613</b>
<b>Klasse B hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		111'169.895	122'838.000
Ausgegebene Anteile		555.000	120.000
Zurückgenommene Anteile		-12'573.848	-11'788.105
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>99'151.047</b>	<b>111'169.895</b>
<b>Klasse It</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		41'114.679	36'553.534
Ausgegebene Anteile		-	4'561.145
Zurückgenommene Anteile		-18'070.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>23'044.679</b>	<b>41'114.679</b>
<b>Klasse It hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		72'206.000	69'846.000
Ausgegebene Anteile		18'050.000	2'360.000
Zurückgenommene Anteile		-2'025.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>88'231.000</b>	<b>72'206.000</b>
<b>Klasse Nt</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		354'012.852	366'609.917
Ausgegebene Anteile		28'905.000	7'812.029
Zurückgenommene Anteile		-91'776.647	-20'409.094
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>291'141.205</b>	<b>354'012.852</b>
<b>Klasse Nt hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'418'252.686	1'465'545.213
Ausgegebene Anteile		161'960.658	149'425.328
Zurückgenommene Anteile		-311'594.764	-132'717.855
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-64'000.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'268'618.580</b>	<b>1'418'252.686</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.09.2023 31.08.2024</b>	<b>01.09.2022 31.08.2023</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		216'258'253.68	238'327'186.88
Ausbezahlte Ausschüttung		-830'749.34	-1'073'818.40
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'822'626.84	-2'154'191.93
Saldo aus dem Anteilverkehr		-23'452'690.37	-9'609'019.21
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		8'333'578.22	-9'231'903.66
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>198'485'765.35</b>	<b>216'258'253.68</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.09.2023 31.08.2024</b>	<b>01.09.2022 31.08.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		31'258.52	34'878.88
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'557.13	-483.24
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		7'362'992.24	6'954'357.13
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		425'258.98	181'693.14
<b>Total Ertrag</b>		<b>7'817'952.61</b>	<b>7'170'445.91</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-3'077.20	-2.95
Reglementarische Vergütungen		-557'107.42	-618'020.77
Sonstige Aufwendungen		0.00	-1.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-678'163.65	-299'727.40
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'238'348.27</b>	<b>-917'752.27</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>6'579'604.34</b>	<b>6'252'693.64</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-19'032'643.47	-12'705'303.35
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		122'229.24	51'390.79
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-12'330'809.89</b>	<b>-6'401'218.92</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		20'664'388.11	-2'830'684.74
<b>Gesamterfolg</b>		<b>8'333'578.22</b>	<b>-9'231'903.66</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse A</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	341'240.48	318'604.60
Vortrag des Vorjahres	2'990.09	4'553.29
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>344'230.57</b>	<b>323'157.89</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	341'667.35	320'167.80
Vortrag auf neue Rechnung	2'563.22	2'990.09
<b>Total</b>	<b>344'230.57</b>	<b>323'157.89</b>
<b>Klasse A hedged</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	619'532.35	541'909.84
Vortrag des Vorjahres	14'736.54	8'569.24
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>634'268.89</b>	<b>550'479.08</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	625'704.18	535'742.54
Vortrag auf neue Rechnung	8'564.71	14'736.54
<b>Total</b>	<b>634'268.89</b>	<b>550'479.08</b>
<b>Klasse B</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	165'659.96	153'581.00
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>165'659.96</b>	<b>153'581.00</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	57'980.99	53'753.35
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	107'678.97	99'827.65
<b>Total</b>	<b>165'659.96</b>	<b>153'581.00</b>
<b>Klasse B hedged</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	219'067.37	197'905.32
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>219'067.37</b>	<b>197'905.32</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	76'673.58	69'266.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	142'393.79	128'638.46
<b>Total</b>	<b>219'067.37</b>	<b>197'905.32</b>
<b>Klasse It</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	67'284.10	101'271.05
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>67'284.10</b>	<b>101'271.05</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	23'549.44	35'444.87
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	43'734.66	65'826.18
<b>Total</b>	<b>67'284.10</b>	<b>101'271.05</b>
<b>Klasse It hedged</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	244'440.81	167'676.62
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>244'440.81</b>	<b>167'676.62</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	85'554.28	58'686.82
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	158'886.53	108'989.80
<b>Total</b>	<b>244'440.81</b>	<b>167'676.62</b>
<b>Klasse Nt</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	967'239.13	1'005'624.64
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>967'239.13</b>	<b>1'005'624.64</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	338'533.70	351'968.62
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	628'705.43	653'656.02
<b>Total</b>	<b>967'239.13</b>	<b>1'005'624.64</b>
<b>Klasse Nt hedged</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	3'955'140.14	3'766'120.57
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>3'955'140.14</b>	<b>3'766'120.57</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'384'299.05	1'318'142.20
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'570'841.09	2'447'978.37
<b>Total</b>	<b>3'955'140.14</b>	<b>3'766'120.57</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>193'507'320.23</b>	<b>97.47</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>193'507'320.23</b>	<b>97.47</b>	
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	0	50	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	0	50	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2106056653	0.2500 % RBAIV 0 1/4 01/22/25 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.59%	370'349.52	0.19	a)
<b>AT</b>							<b>370'349.52</b>	<b>0.19</b>	
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	0	150	0	150 AUD	57.34%	49'510.21	0.02	a)
AU000XCLWA18	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	2'000	0	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0302719	5.3500 % VW 5.35 09/15/26 MTN	0	1'100	0	1'100 AUD	100.56%	636'799.48	0.32	a)
US00205GAC15	5.0000 % APAAU 5 03/23/35 144A	1'000	0	600	400 USD	96.43%	327'253.95	0.16	a)
US55607PAG00	2.6910 % MQGAU 2.691 06/23/32 144A	1'000	0	0	1'000 USD	85.59%	726'179.87	0.37	a)
US55608JAZ12	2.8710 % MQGAU 2.871 01/14/33 144A	0	1'000	0	1'000 USD	85.59%	726'145.93	0.37	a)
US89400PAE34	4.1250 % TCLAU 4 1/8 02/02/26 144A	3'000	0	500	2'500 USD	98.96%	2'099'065.30	1.06	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	99.14%	1'682'238.78	0.85	a)
XS2315784715	0.7500 % APAAU 3 03/17/31 EMTN	450	0	0	450 EUR	88.65%	374'643.33	0.19	a)
XS2575952937	3.7990 % WSTP 3.799 01/17/30 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2887839855	4.6250 % TOYOTA 4 5/8 03/29/28 EMTN	0	400	0	400 GBP	99.64%	444'406.61	0.22	a)
<b>AU</b>							<b>7'066'243.46</b>	<b>3.56</b>	
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	87.75%	988'951.11	0.50	a)
<b>BE</b>							<b>988'951.11</b>	<b>0.50</b>	
AU3CB0309268	5.3500 % ONT 5.35 05/08/34 MTN	0	100	0	100 AUD	103.91%	59'817.06	0.03	a)
AU3CB0309763	5.2500 % BRCOL 5 1/4 05/23/34 MTN	0	100	0	100 AUD	103.10%	59'349.04	0.03	a)
CA06368BTX69	3.1900 % BMO 3.19 03/01/28 DPNT	1'940	0	250	1'690 CAD	98.28%	1'045'650.24	0.53	a)
CA07813ZCB81	2.7500 % BCECN 2 3/4 01/29/25 MTN	0	500	0	500 CAD	99.28%	312'499.04	0.16	a)
CA07813ZCG78	3.0000 % BCECN 3 03/17/31 MTN	400	0	0	400 CAD	92.23%	232'254.02	0.12	a)
CA11282ZAP32	4.2900 % BAMREP 4.29 11/05/49 MTN	0	500	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	1'300	0	1'300	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087Z568	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	0	400	400	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA136375CM29	3.6000 % CNRCN 3.6 08/01/47	0	340	0	340 CAD	83.44%	178'601.76	0.09	a)
CA29260ZAD83	3.6500 % ENBGAS 3.65 04/01/50 MTN	0	340	0	340 CAD	82.61%	176'808.10	0.09	a)
CA44810ZAS98	4.8900 % HYDONE 4.89 03/13/37 MTN	500	0	0	500 CAD	102.72%	323'320.67	0.16	a)
CA44932WAE09	4.8130 % HYNMTR 4.813 02/01/27	0	340	0	340 CAD	101.67%	217'614.91	0.11	a)
CA47788ZAK71	1.0900 % DE 1.09 07/17/24	0	500	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA628153AA60	3.6300 % CANMFA 3.63 06/01/29 A	2'100	0	0	2'100 CAD	101.56%	1'342'571.80	0.68	a)
CA87971MAS22	4.4000 % TCN 4.4 04/01/43 MTN	250	0	0	250 CAD	87.72%	138'049.79	0.07	a)
CA87971MAX17	3.7500 % TCN 3 3/4 01/17/25 CQ	0	430	0	430 CAD	99.70%	269'888.81	0.14	a)
CA87971MBV42	2.8500 % TCN 2.85 11/13/31 CAF	400	0	0	400 CAD	89.92%	226'422.05	0.11	a)
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	1'940	0	1'940	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
US06417XAP69	4.8500 % BNS 4.85 02/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	101.51%	861'287.05	0.43	a)
US13645RAX26	6.1250 % CP 6 1/8 09/15/2115	200	0	0	200 USD	106.57%	180'833.54	0.09	a)
US559222AY07	5.5000 % MGCN 5 1/2 03/21/33	0	350	0	350 USD	105.02%	311'873.68	0.16	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016HZZ62	4.9690 % RY 4.969 08/02/30 GMTN	0	600	0	600 USD	101.73%	517'882.00	0.26	a)
US89352HBA68	4.1000 % TRPCN 4.1 04/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	97.43%	826'661.80	0.42	a)
XS1945965611	0.8750 % CPPIBC 0 7/8 02/06/29 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2856789511	3.7500 % BMO 3 3/4 07/10/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.52%	377'629.84	0.19	a)
<b>CA</b>							<b>7'659'015.20</b>	<b>3.86</b>	
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
USH42097EN39	6.2460 % UBS 6.246 09/22/29 REGS	0	200	0	200 USD	105.35%	178'766.72	0.09	a)
USH42097EQ69	6.3010 % UBS 6.301 09/22/34 REGS	0	250	0	250 USD	107.83%	228'716.67	0.12	a)
<b>CH</b>							<b>407'483.39</b>	<b>0.21</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X51084942470	2.2500 % CDEL 2 1/4 07/09/24 REGS	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52388560604	0.5550 % CHILE 0.555 01/21/29	2'000	0	500	1'500 EUR	89.08%	1'254'896.83	0.63	a)
<b>CL</b>							<b>1'254'896.83</b>	<b>0.63</b>	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	0	1'150	1'150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	780	780	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.77%	899'380.29	0.45	a)
DE000BHY0BP6	1.0000 % BHH 1 02/05/26 EMTN	0	600	0	600 EUR	96.45%	543'471.19	0.27	a)
DE000BHY0GS9	1.1250 % BHH 1 1/8 10/25/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	92.97%	349'256.14	0.18	a)
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X50460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	0	400	0	400 USD	100.13%	339'827.98	0.17	a)
X50460071078	5.5200 % DB 5.52 09/01/28 EMTN	0	400	0	400 USD	100.95%	342'600.72	0.17	a)
X52396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52484327999	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 05/24/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52629470845	4.0000 % RBOSGR 4 06/02/35 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.39%	388'392.54	0.20	a)
<b>DE</b>							<b>2'862'928.86</b>	<b>1.44</b>	
X52100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	700	0	0	700 GBP	93.63%	730'823.77	0.37	a)
X52671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	3'000	0	1'650	1'350 GBP	104.70%	1'576'133.45	0.79	a)
<b>DK</b>							<b>2'306'957.22</b>	<b>1.16</b>	
E500000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	0	300	0	300 EUR	89.30%	251'602.02	0.13	a)
E50000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	0	1'000	0	1'000 EUR	94.02%	883'020.24	0.44	a)
US05964HAF29	3.8000 % SANTAN 3.8 02/23/28	2'000	0	0	2'000 USD	97.03%	1'646'536.01	0.83	a)
X51201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	1'000	0	300	700 EUR	99.30%	652'772.69	0.33	a)
X52645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	99.33%	578'779.55	0.29	a)
X52676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	700	0	400	300 EUR	104.76%	295'162.78	0.15	a)
X52751598322	3.6250 % ENGSM 3 5/8 01/24/34 EMTN	0	800	0	800 EUR	99.74%	749'339.26	0.38	a)
<b>ES</b>							<b>5'057'212.55</b>	<b>2.55</b>	
US65559CAE12	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 144A	800	0	0	800 USD	93.90%	637'328.49	0.32	a)
X52185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>FI</b>							<b>637'328.49</b>	<b>0.32</b>	
AU3C80252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	2'000	0	0	2'000 AUD	97.03%	1'117'117.12	0.56	a)
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	600	0	0	600 EUR	92.59%	521'720.40	0.26	a)
FR0013464963	4.5000 % EDF 4 1/2 12/04/69 EMTN	600	0	0	600 USD	77.35%	393'765.65	0.20	a)
FR0013515749	1.2500 % BFCM 1 1/4 06/03/30	900	0	0	900 EUR	87.79%	742'042.98	0.37	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	800	0	0	800 EUR	88.34%	663'726.03	0.33	a)
FR0014000717	0.6250 % BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN	900	0	0	900 EUR	82.82%	700'017.74	0.35	a)
FR0014007LK5	0.8750 % BNP 0 7/8 07/11/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	88.08%	1'654'337.57	0.83	a)
FR001400DNF5	5.3750 % ENFP 5 3/8 06/30/42	0	1'000	700	300 EUR	116.19%	327'369.17	0.16	a)
FR001400EHG3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 12/06/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	101.80%	956'095.77	0.48	a)
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	700	0	200	500 EUR	104.31%	489'815.48	0.25	a)
FR001400KHF2	3.7500 % ENGIFP 3 3/4 09/06/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.60%	954'179.90	0.48	a)
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	0	500	100	400 EUR	103.90%	390'304.66	0.20	a)
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFF 5 1/2 10/09/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	106.55%	1'000'649.21	0.50	a)
FR001400NC70	3.8750 % AYVFP 3 7/8 01/24/28	0	400	0	400 EUR	101.15%	379'977.73	0.19	a)
FR001400PX40	3.3750 % RIFP 3 3/8 11/07/30 EMTN	0	500	0	500 EUR	100.36%	471'281.28	0.24	a)
FR001400QZ47	3.6250 % EDENFP 3 5/8 08/05/32	0	400	0	400 EUR	99.99%	375'623.81	0.19	a)
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US05583JAG76	2.3750 % BPCEGP 2 3/8 01/14/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	98.81%	838'311.02	0.42	a)
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.76%	837'895.28	0.42	a)
US29286DAB10	5.6250 % ENGIFP 5 5/8 04/10/34 144A	0	500	0	500 USD	103.47%	438'962.58	0.22	a)
US29286DAC92	5.8750 % ENGIFP 5 7/8 04/10/54 144A	0	400	0	400 USD	102.49%	347'833.96	0.18	a)
US35177PAX50	5.3750 % ORAFP 5 3/8 01/13/42	1'000	0	0	1'000 USD	99.68%	845'743.44	0.43	a)
USF1R15XK516	4.3750 % BNP 4 3/8 05/12/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	98.96%	1'679'252.24	0.85	a)
USF43628C650	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 08/19/26 REGS	500	0	0	500 USD	97.70%	414'472.07	0.21	a)
X52451372499	1.2500 % AYVFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	1'400	0	600	800 EUR	97.11%	729'579.47	0.37	a)
<b>FR</b>							<b>17'270'074.56</b>	<b>8.70</b>	
GB00884Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	0	450	0	450 GBP	84.73%	425'151.49	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	110	110	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BHFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	0	190	0	190 GBP	99.95%	211'766.87	0.11	a)
US046353AD01	6.4500 % AZN 6.45 09/15/37	1'000	0	0	1'000 USD	115.25%	977'821.66	0.49	a)
US06738EAP07	5.2000 % BACR 5.2 05/12/26	2'000	0	0	2'000 USD	100.27%	1'701'413.75	0.86	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	2'000	0	1'000	1'000 USD	125.52%	1'065'008.38	0.54	a)
US11778BAB80	6.5000 % CMCSA 6 1/2 10/15/35 144A	0	500	0	500 USD	112.20%	475'980.45	0.24	a)
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	1'000	0	0	1'000 USD	99.19%	841'577.56	0.42	a)
US404280BX62	4.2920 % HSBC 4.292 09/12/26	0	800	0	800 USD	99.25%	673'662.51	0.34	a)
US404280DA42	2.9990 % HSBC 2.999 03/10/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45262BAG86	5.5000 % IMBLN 5 1/2 02/01/30 144A	0	1'000	0	1'000 USD	101.97%	865'130.53	0.44	a)
US45262BAH69	5.8750 % IMBLN 5 7/8 07/01/34 144A	0	2'000	0	2'000 USD	102.06%	1'731'822.20	0.87	a)
US53944YAB92	4.6500 % LLOYDS 4.65 03/24/26	2'000	0	0	2'000 USD	99.37%	1'686'277.41	0.85	a)
US780097BK63	4.2690 % NWG 4.269 03/22/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	1'500	0	0	1'500 USD	86.04%	1'094'971.39	0.55	a)
US853254CE80	1.8220 % STANLN 1.822 11/23/25 144A	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US853254CG39	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 144A	1'500	0	0	1'500 USD	94.74%	1'205'694.11	0.61	a)
US92857WAB63	6.2500 % VOD 6 1/4 11/30/32	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBS89	4.8750 % VOD 4 7/8 06/19/49	500	0	0	500 USD	90.32%	383'164.26	0.19	a)
US92857WBZ23	5.7500 % VOD 5 3/4 02/10/63	700	0	0	700 USD	99.08%	588'427.23	0.30	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	2'000	0	1'000	1'000 USD	99.88%	847'406.41	0.43	a)
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X50097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	100	0	0	100 GBP	104.20%	116'190.86	0.06	a)
X50158715713	5.9000 % VOD 5.9 11/26/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.67%	118'939.52	0.06	a)
X50753789980	4.3750 % CNALN 4 3/8 03/13/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	97.86%	1'091'179.34	0.55	a)
X51171485722	1.1250 % WELLTR 1 1/8 01/21/27	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51203859928	1.2500 % BATSLN 1 1/4 03/13/27 EMTN	0	320	320	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	100	0	0	100 GBP	93.07%	103'776.72	0.05	a)
X52525246901	3.2500 % NWIDE 3 1/4 09/05/29 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.09%	113'834.70	0.06	a)
X52669894821	6.1250 % NWIDE 6 1/8 08/21/28 EMTN	600	0	0	600 GBP	104.48%	699'045.23	0.35	a)
X52690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	106.08%	99'623.52	0.05	a)
X52742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	0	500	0	500 EUR	101.29%	475'615.48	0.24	a)
<b>GB</b>							<b>17'593'481.58</b>	<b>8.86</b>	
USY5257YAL12	5.8310 % LENOVO 5.831 01/27/28 REGS	0	500	0	500 USD	102.68%	435'573.02	0.22	a)
<b>HK</b>							<b>435'573.02</b>	<b>0.22</b>	
X51268430201	3.3750 % INDON 3 3/8 07/30/25 REGS	1'000	0	0	1'000 EUR	99.64%	935'800.66	0.47	a)
<b>ID</b>							<b>935'800.66</b>	<b>0.47</b>	
X51108784510	4.5000 % SRENVX 4 1/2 09/11/44	2'000	0	650	1'350 USD	99.90%	1'144'262.09	0.58	a)
X51385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	500	0	0	500 USD	100.02%	424'301.36	0.21	a)
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	85.86%	1'019'906.47	0.51	a)
X52463961677	1.6250 % LIN 1 5/8 03/31/35	0	500	0	500 EUR	84.33%	395'998.74	0.20	a)
X52586851300	4.0000 % VOD 4 02/10/43 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.42%	377'250.42	0.19	a)
<b>IE</b>							<b>3'361'719.08</b>	<b>1.69</b>	
X50986194883	4.0000 % ISPIM 4 10/30/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.94%	89'166.05	0.04	a)
X52265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	700	0	0	700 EUR	93.64%	615'609.44	0.31	a)
X52348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	94.98%	1'611'732.59	0.81	a)
<b>IT</b>							<b>2'316'508.08</b>	<b>1.17</b>	
US90351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	3'000	0	950	2'050 USD	98.98%	1'721'529.23	0.87	a)
X52242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	2'000	0	200	1'800 EUR	98.01%	1'656'751.19	0.83	a)
<b>JE</b>							<b>3'378'280.42</b>	<b>1.70</b>	
US606822BU78	2.0480 % MUFG 2.048 07/17/30	0	1'000	0	1'000 USD	86.64%	735'097.08	0.37	a)
US65535HAP47	2.6480 % NOMURA 2.648 01/16/25	1'000	0	0	1'000 USD	99.00%	839'965.50	0.42	a)
US86562MCE84	1.7100 % SUMIBK 1.71 01/12/31	1'000	0	0	1'000 USD	83.04%	704'510.46	0.35	a)
US86562MCS70	5.7660 % SUMIBK 5.766 01/13/33	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060BM73	5.6500 % TACHEM 5.65 07/05/54	0	600	0	600 USD	102.07%	519'607.75	0.26	a)
US874060BN56	5.8000 % TACHEM 5.8 07/05/64	0	600	0	600 USD	102.25%	520'539.35	0.26	a)
X52459747874	1.8500 % EJRAIL 1.85 04/13/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	89.52%	840'767.73	0.42	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52489982293	3.5560 % MUFG 3.556 06/15/32 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52589713614	4.4160 % MIZUHO 4.416 05/20/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	104.88%	393'978.62	0.20	a)
<b>JP</b>							<b>4'554'466.49</b>	<b>2.29</b>	
X52058731717	0.2500 % SHNHAN 0 1/4 10/16/24 GMTN	800	0	0	800 EUR	99.50%	747'528.57	0.38	a)
<b>KR</b>							<b>747'528.57</b>	<b>0.38</b>	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88032XAN49	3.9750 % TENCNT 3.975 04/11/29 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	97.68%	828'757.48	0.42	a)
<b>KY</b>							<b>828'757.48</b>	<b>0.42</b>	
DE000A3LHK72	4.0000 % TRAGR 4 09/16/25 EMTN	0	600	0	600 EUR	100.33%	565'334.68	0.28	a)
ES0305523005	0.0000 % SIXLTD 0 12/02/25	0	600	0	600 EUR	95.74%	539'459.13	0.27	a)
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	1'400	690	0	2'090 EUR	58.77%	1'153'555.60	0.58	a)
X51637162592	1.2000 % DHR 1.2 06/30/27	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51769041606	1.7000 % NOVNVX 1.7 08/14/38	0	380	0	380 EUR	84.14%	300'273.84	0.15	a)
X51960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	1'200	0	800	400 EUR	83.49%	313'654.71	0.16	a)
X52286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	78.73%	1'330'861.19	0.67	a)
X52318745937	1.2620 % ISDB 1.262 03/31/26	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>4'203'139.15</b>	<b>2.12</b>	
US02364WAP05	6.1250 % AMXLMM 6 1/8 11/15/37	1'000	0	0	1'000 USD	108.80%	923'096.63	0.46	a)
US05969BAD55	5.3750 % BSMXB 5 3/8 04/17/25 144A	1'000	0	0	1'000 USD	99.92%	847'737.30	0.43	a)
US91086QAZ19	5.7500 % MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN	200	0	0	200 USD	85.43%	144'961.08	0.07	a)
US91087BAS97	4.4000 % MEX 4.4 02/12/52	400	0	0	400 USD	75.76%	257'121.08	0.13	a)
USP60694AF68	2.4310 % KCMA 2.431 07/01/31 REGS	1'150	0	0	1'150 USD	87.28%	851'635.51	0.43	a)
X51974394675	1.6250 % MEX 1 5/8 04/08/26	100	0	0	100 EUR	96.85%	90'957.01	0.05	a)
X52363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	0	800	0	800 EUR	77.72%	583'943.07	0.29	a)
<b>MX</b>							<b>3'699'451.68</b>	<b>1.86</b>	
US00084DAW02	2.4700 % ABNAV 2.47 12/13/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	90.80%	770'401.08	0.39	a)
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	700	0	300	400 USD	120.14%	407'720.95	0.21	a)
US29278GAC24	4.7500 % ENELIM 4 3/4 05/25/47 144A	0	600	0	600 USD	89.58%	456'014.72	0.23	a)
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	100	0	0	100 USD	95.90%	81'366.36	0.04	a)
US29278GAV05	4.2500 % ENELIM 4 1/4 06/15/25 144A	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278GAX60	5.0000 % ENELIM 5 06/15/32 144A	2'000	0	0	2'000 USD	99.56%	1'689'450.61	0.85	a)
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	0	500	0	500 USD	107.00%	453'903.78	0.23	a)
US74977RDR21	4.6550 % RABOBK 4.655 08/22/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	99.83%	847'016.12	0.43	a)
US780641AH94	8.3750 % KPN 8 3/8 10/01/30	1'700	0	400	1'300 USD	118.20%	1'303'772.39	0.66	a)
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X50148579666	6.3750 % EOANGR 6 3/8 06/07/32 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	108.16%	1'809'148.52	0.91	a)
X51261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	2'000	0	0	2'000 USD	100.03%	1'697'476.95	0.86	a)
X5170553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52084050637	0.3750 % NNGRNV 0 3/8 02/26/25	1'000	0	900	100 EUR	98.39%	92'398.61	0.05	a)
X52191362859	1.2500 % DLR 1 1/4 02/01/31	1'000	0	0	1'000 EUR	85.56%	803'511.51	0.40	a)
X52258452478	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/18/29	1'500	0	0	1'500 EUR	89.63%	1'262'602.58	0.64	a)
X52360881549	0.7500 % DSVDC 0 3/4 07/05/33 EMTN	0	500	0	500 EUR	79.44%	373'022.35	0.19	a)
X52475954579	1.8750 % PHIANA 1 7/8 05/05/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.70%	908'180.16	0.46	a)
X52591848192	3.5000 % UNANA 3 1/2 02/23/35	0	420	0	420 EUR	102.36%	403'765.17	0.20	a)
X52676863355	4.2500 % PHIANA 4 1/4 09/08/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.24%	195'794.71	0.10	a)
X52715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	300	0	300 EUR	106.45%	299'918.65	0.15	a)
X52827697272	3.6250 % SCMNVX 3 5/8 11/29/36 EMTN	0	640	0	640 EUR	101.37%	609'292.70	0.31	a)
X52887901325	3.0000 % BMW 3 08/27/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.99%	187'802.51	0.09	a)
<b>NL</b>							<b>14'652'560.43</b>	<b>7.38</b>	
X52768793676	3.3750 % STATNE 3 3/8 02/26/36 EMTN	0	500	0	500 EUR	99.53%	467'346.23	0.24	a)
<b>NO</b>							<b>467'346.23</b>	<b>0.24</b>	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>PE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
US83051GAU22	1.4000 % SEB 1.4 11/19/25 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86959LAP85	5.5000 % SHBASS 5 1/2 06/15/28 144A	600	0	0	600 USD	102.84%	523'547.95	0.26	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US86960BAX01	3.9000 % SHBASS 3.9 11/20/23 BKNT	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87020PAV94	5.4720 % SWEDA 5.472 06/15/26 144A	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343459074	0.6250 % NDAFH 0 5/8 08/18/31 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	94.83%	1'424'898.63	0.72	a)
XS2442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	93.30%	438'115.08	0.22	a)
XS2443485565	1.3000 % SWEDA 1.3 02/17/27 GMTN	0	700	0	700 EUR	95.50%	627'824.07	0.32	a)
XS2641720987	4.8750 % SBAB 4 7/8 06/26/26 EMTN	0	300	100	200 EUR	100.78%	189'297.65	0.10	a)
<b>SE</b>							<b>3'203'683.38</b>	<b>1.61</b>	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	800	0	0	800 USD	99.30%	673'974.74	0.34	a)
US33938XAF24	5.2500 % FLEX 5 1/4 01/15/32	0	400	0	400 USD	99.98%	339'322.31	0.17	a)
US449276AG99	5.3000 % IBM 5.3 02/05/54	0	500	0	500 USD	98.43%	417'556.18	0.21	a)
XS2080786150	1.2500 % TEMASE 1 1/4 11/20/49 GMTN	620	0	0	620 EUR	62.67%	364'906.00	0.18	a)
<b>SG</b>							<b>1'795'759.23</b>	<b>0.90</b>	
CA00206RDY59	4.8500 % T 4.85 05/25/47 MPLE	0	300	0	300 CAD	92.36%	174'430.37	0.09	a)
US00206RCQ39	4.7500 % T 4 3/4 05/15/46	500	0	0	500 USD	90.41%	383'533.34	0.19	a)
US00206RKH48	2.2500 % T 2 1/4 02/01/32	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	500	0	0	500 USD	70.65%	299'706.48	0.15	a)
US00287YAR09	4.5000 % ABBV 4 1/2 05/14/35	1'000	0	500	500 USD	98.16%	416'427.74	0.21	a)
US00724PAG46	4.9500 % ADBE 4.95 04/04/34	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US022095BF92	5.9500 % MO 5.95 02/14/49	500	0	0	500 USD	102.93%	436'671.76	0.22	a)
US023135BT22	2.5000 % AMZN 2 1/2 06/03/50	2'000	0	1'200	800 USD	64.01%	434'474.28	0.22	a)
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	1'000	0	0	1'000 USD	84.17%	714'114.91	0.36	a)
US02665WDW82	2.0000 % HNDA 2 03/24/28 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAZ33	2.4000 % AMT 2.4 03/15/25	100	0	0	100 USD	98.42%	83'501.06	0.04	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	100	0	0	100 USD	91.54%	77'670.51	0.04	a)
US031162CR97	3.1500 % AMGN 3.15 02/21/40	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	0	1'000	0	1'000 USD	102.76%	871'901.16	0.44	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	800	0	400	400 USD	102.80%	348'875.85	0.18	a)
US03522AAJ97	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	1'500	0	500	1'000 USD	96.04%	814'859.86	0.41	a)
US035240AG57	4.9500 % ABIBB 4.95 01/15/42	100	0	0	100 USD	98.18%	83'298.28	0.04	a)
US036752AC75	3.3500 % ELV 3.35 12/01/24	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	86.25%	658'586.40	0.33	a)
US037833DZ01	2.4000 % AAPL 2.4 08/20/50	2'000	0	1'300	700 USD	64.51%	383'104.87	0.19	a)
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04685A2V22	2.5000 % ATH 2 1/2 03/24/28 144A	500	0	500	500 USD	91.76%	389'273.10	0.20	a)
US05351WAC73	3.2000 % AGR 3.2 04/15/25	0	900	0	900 USD	98.69%	753'578.87	0.38	a)
US054989AA67	6.3430 % BATSLN 6.343 08/02/30	0	600	0	600 USD	107.51%	547'311.34	0.28	a)
US05526DBG97	2.7890 % BATSLN 2.789 09/06/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565EBE41	3.9500 % BMW 3.95 08/14/28 144A	1'000	0	550	450 USD	98.24%	375'078.96	0.19	a)
US05723KAG58	3.1380 % BHI 3.138 11/07/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US059165EC09	6.3500 % EXC 6.35 10/01/36	0	410	0	410 USD	110.98%	386'046.11	0.19	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	1'800	0	0	1'800 USD	96.38%	1'471'986.09	0.74	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	89.32%	757'827.06	0.38	a)
US06051GJR11	0.9760 % BAC 0.976 04/22/25	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US07177MAB90	4.0000 % TACHEM 4 06/23/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US08652BAB53	1.9500 % BBY 1.95 10/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	86.32%	1'464'747.11	0.74	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	500	0	0	500 USD	88.26%	374'412.50	0.19	a)
US09290DAK72	5.3500 % BLK 5.35 01/08/55	0	500	0	500 USD	102.83%	436'209.36	0.22	a)
US110122DX32	3.9000 % BMY 3.9 03/15/62	1'000	0	0	1'000 USD	76.35%	647'808.54	0.33	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	100	0	0	100 USD	77.72%	65'942.38	0.03	a)
US11135FBH38	2.4500 % AVGO 2.45 02/15/31 144A	0	1'000	0	1'000 USD	87.22%	740'052.03	0.37	a)
US114259AW41	4.8660 % NGGLN 4.866 08/05/32 144A	270	0	0	270 USD	96.09%	220'124.41	0.11	a)
US12189LBK61	5.2000 % BNSF 5.2 04/15/54	0	500	0	500 USD	100.19%	425'018.30	0.21	a)
US125523AJ93	4.8000 % CI 4.8 08/15/38	0	400	0	400 USD	95.71%	324'803.63	0.16	a)
US125523CV04	5.2500 % CI 5 1/4 02/15/34	0	300	0	300 USD	102.08%	259'831.87	0.13	a)
US126408GK35	6.1500 % CSX 6.15 05/01/37	800	0	0	800 USD	111.35%	755'772.11	0.38	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	900	0	0	900 USD	88.64%	676'859.47	0.34	a)
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	500	0	500 USD	100.54%	426'498.85	0.21	a)
US161175CA05	3.9000 % CHTR 3.9 06/01/52	160	0	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	1'800	0	0	1'800 USD	99.45%	1'518'856.16	0.77	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US20030NBQ34	4.6000 % CMCSA 4.6 08/15/45	1'650	0	750	900 USD	90.90%	694'132.22	0.35	a)
US219350AV70	5.7500 % GLW 5 3/4 08/15/40	0	400	0	400 USD	103.29%	350'559.18	0.18	a)
US219350AW53	4.7500 % GLW 4 3/4 03/15/42	0	400	0	400 USD	92.39%	313'566.76	0.16	a)
US22822VBF76	4.9000 % CCI 4.9 09/01/29	0	300	0	300 USD	100.86%	256'711.27	0.13	a)
US254687EB89	6.4000 % DIS 6.4 12/15/35	0	300	0	300 USD	113.41%	288'675.78	0.15	a)
US254687FY73	3.5000 % DIS 3 1/2 05/13/40	1'500	0	0	1'500 USD	82.89%	1'054'869.40	0.53	a)
US260543BJ10	7.3750 % DOW 7 3/8 11/01/29	2'000	0	300	1'700 USD	112.99%	1'629'771.48	0.82	a)
US30040WAT53	5.4500 % ES 5.45 03/01/28	0	1'000	0	1'000 USD	102.52%	869'805.49	0.44	a)
US30303M8H84	3.8500 % META 3.85 08/15/32	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8Q83	5.6000 % META 5.6 05/15/53	800	0	400	400 USD	105.32%	357'445.20	0.18	a)
US30303M8S40	4.3000 % META 4.3 08/15/29	0	300	0	300 USD	100.66%	256'214.93	0.13	a)
US30303M8T23	4.5500 % META 4.55 08/15/31	0	300	0	300 USD	100.95%	256'958.17	0.13	a)
US31428XBB10	4.1000 % FDX 4.1 02/01/45	0	400	0	400 USD	82.32%	279'364.04	0.14	a)
US36266GAA58	4.8000 % GEHC 4.8 08/14/29	0	600	0	600 USD	100.78%	513'050.93	0.26	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	1'000	0	0	1'000 USD	101.22%	858'784.12	0.43	a)
US37045XDD57	1.2500 % GM 1 1/4 01/08/26	3'000	0	1'150	1'850 USD	95.41%	1'497'554.98	0.75	a)
US372460AF25	4.9500 % GPC 4.95 08/15/29	0	400	0	400 USD	100.61%	341'446.82	0.17	a)
US375558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	1'100	0	0	1'100 USD	104.71%	977'262.53	0.49	a)
US375558BZ59	5.2500 % GILD 5 1/4 10/15/33	0	350	0	350 USD	104.11%	309'174.33	0.16	a)
US38141GZP26	3.0000 % GS 3 03/15/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAC90	3.4000 % HPQ 3.4 06/17/30	0	1'400	0	1'400 USD	93.84%	1'114'600.28	0.56	a)
US444859BG60	4.8000 % HUM 4.8 03/15/47	0	400	0	400 USD	88.27%	299'580.91	0.15	a)
US444859BV38	5.8750 % HUM 5 7/8 03/01/33	0	300	0	300 USD	105.06%	267'404.29	0.13	a)
US44891CBN20	1.8000 % HYNMTR 1.8 10/15/25 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	96.64%	819'950.56	0.41	a)
US458140BV11	2.8000 % INTC 2.8 08/12/41	1'000	0	0	1'000 USD	68.29%	579'364.08	0.29	a)
US458140BY59	3.7500 % INTC 3 3/4 08/05/27	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CL20	5.1500 % INTC 5.15 02/21/34	0	650	0	650 USD	99.12%	546'644.88	0.28	a)
US459506AN18	1.2300 % IFF 1.23 10/01/25 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PAV85	4.2030 % JPM 4.203 07/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	98.71%	837'505.00	0.42	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	2'200	0	700	1'500 USD	84.48%	1'075'143.11	0.54	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	1'000	0	0	1'000 USD	91.22%	773'981.54	0.39	a)
US501044DS75	4.6000 % KR 4.6 08/15/27	0	250	0	250 USD	100.27%	212'680.96	0.11	a)
US501044DV05	5.0000 % KR 5 09/15/34	0	500	0	500 USD	99.70%	422'931.11	0.21	a)
US501044DW87	5.5000 % KR 5 1/2 09/15/54	0	500	0	500 USD	97.88%	415'218.70	0.21	a)
US532457CS55	5.0500 % LLY 5.05 08/14/54	0	600	0	600 USD	100.33%	510'744.84	0.26	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	2'000	0	800	1'200 USD	100.98%	1'028'087.23	0.52	a)
US571676AC90	3.6000 % MARS 3.6 04/01/34 144A	0	800	400	400 USD	91.05%	309'002.10	0.16	a)
US571903BD44	5.7500 % MAR 5 3/4 05/01/25 EE	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	800	0	500	300 USD	81.97%	208'644.88	0.11	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	1'450	0	0	1'450 USD	105.41%	1'296'759.95	0.65	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	2'150	0	1'450	700 USD	71.68%	425'712.33	0.21	a)
US595112BV48	6.7500 % MU 6 3/4 11/01/29	1'300	0	900	400 USD	108.77%	369'133.44	0.19	a)
US609207AY17	1.8750 % MDLZ 1 7/8 10/15/32	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US609207BE44	4.7500 % MDLZ 4 3/4 08/28/34	0	200	0	200 USD	99.42%	168'712.59	0.08	a)
US615369AE53	5.2500 % MCO 5 1/4 07/15/44	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US615369AP01	4.2500 % MCO 4 1/4 02/01/29	1'000	0	500	500 USD	99.59%	422'489.92	0.21	a)
US61746BEF94	3.6250 % MS 3 5/8 01/20/27	1'264	0	1'264	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61746BEG77	4.3750 % MS 4 3/8 01/22/47 MTN	700	0	0	700 USD	89.53%	531'702.40	0.27	a)
US61747YF590	5.0420 % MS 5.042 07/19/30	0	1'500	0	1'500 USD	101.68%	1'294'005.03	0.65	a)
US63111XAE13	2.5000 % NDAQ 2 1/2 12/21/40	2'250	0	400	1'850 USD	69.56%	1'091'883.46	0.55	a)
US641062AL84	3.9000 % NESNVX 3.9 09/24/38 144A	1'500	0	500	1'000 USD	91.16%	773'413.08	0.39	a)
US641062BG80	4.9500 % NESNVX 4.95 03/14/30 144A	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65339KCH14	4.6250 % NEE 4 5/8 07/15/27	1'000	0	200	800 USD	100.68%	683'348.42	0.34	a)
US65364UAL08	4.2780 % NGGLN 4.278 12/15/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.01%	831'531.91	0.42	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	1'000	0	0	1'000 USD	95.53%	810'541.25	0.41	a)
US66989HAR93	2.2000 % NOVNVX 2.2 08/14/30	2'600	0	2'100	500 USD	89.81%	381'009.20	0.19	a)
US68389XBQ79	4.0000 % ORCL 4 11/15/47	400	0	0	400 USD	79.03%	268'222.20	0.14	a)
US68389XBY04	3.8500 % ORCL 3.85 04/01/60	200	0	0	200 USD	71.99%	122'156.44	0.06	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	100	0	0	100 USD	92.84%	78'766.70	0.04	a)
US693475BM68	5.0680 % PNC 5.068 01/24/34	0	1'000	0	1'000 USD	99.96%	848'144.56	0.43	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US70450YAN31	5.2500 % PYPL 5 1/4 06/01/62	500	0	0	500 USD	97.50%	413'627.86	0.21	a)
US717081EZ22	2.5500 % PFE 2.55 05/28/40	1'000	0	0	1'000 USD	72.83%	617'934.62	0.31	a)
US718172BL29	4.2500 % PM 4 1/4 11/10/44	1'200	0	0	1'200 USD	85.84%	873'981.56	0.44	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	2'700	0	1'900	800 USD	83.15%	564'402.52	0.28	a)
US74368CBL72	3.2180 % PL 3.218 03/28/25 144A	800	0	0	800 USD	98.84%	670'886.38	0.34	a)
US744573AW69	5.8750 % PEG 5 7/8 10/15/28	0	1'000	0	1'000 USD	104.57%	887'207.20	0.45	a)
US744573AX43	6.1250 % PEG 6 1/8 10/15/33	0	500	0	500 USD	107.57%	456'317.62	0.23	a)
US74762EAK82	4.7500 % PWR 4 3/4 08/09/27	0	600	0	600 USD	100.47%	511'462.63	0.26	a)
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	800	0	0	800 USD	88.68%	601'951.52	0.30	a)
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US771196BY74	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 144A	1'000	0	0	1'000 USD	64.76%	549'464.70	0.28	a)
US776696AH96	4.7500 % ROP 4 3/4 02/15/32	0	300	0	300 USD	99.93%	254'354.28	0.13	a)
US828807DQ71	2.2500 % SPG 2 1/4 01/15/32	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US828807DV66	5.8500 % SPG 5.85 03/08/53	0	550	0	550 USD	104.38%	487'072.66	0.25	a)
US842400FP31	5.5000 % EIX 5 1/2 03/15/40	970	0	0	970 USD	101.89%	838'534.67	0.42	a)
US842400HY20	5.6500 % EIX 5.65 10/01/28	0	800	0	800 USD	104.17%	707'043.93	0.36	a)
US842434CY66	5.7500 % SRE 5 3/4 06/01/53	500	0	0	500 USD	104.09%	441'567.32	0.22	a)
US845011AC92	2.2000 % SWX 2.2 06/15/30	1'000	0	700	300 USD	87.51%	222'735.94	0.11	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACX19	5.8000 % TMUS 5.8 09/15/62	1'000	0	500	500 USD	103.34%	438'411.08	0.22	a)
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88579YAZ43	3.6250 % MMM 3 5/8 10/15/47 MTN	0	400	0	400 USD	77.94%	264'505.98	0.13	a)
US89236TMK87	4.5500 % TOYOTA 4.55 08/09/29	0	1'200	0	1'200 USD	100.79%	1'026'173.12	0.52	a)
US898813AW06	5.2000 % FTSCN 5.2 09/15/34	0	400	0	400 USD	100.32%	340'449.05	0.17	a)
US902494AZ66	4.8750 % TSN 4 7/8 08/15/34	0	700	0	700 USD	98.98%	587'833.31	0.30	a)
US904764BU02	4.2500 % UNANA 4 1/4 08/12/27	0	300	0	300 USD	100.37%	255'466.60	0.13	a)
US904764BV84	4.6250 % UNANA 4 5/8 08/12/34	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US911312AJ59	6.2000 % UPS 6.2 01/15/38	500	0	0	500 USD	112.30%	476'387.71	0.24	a)
US911312BZ82	4.8750 % UPS 4 7/8 03/03/33	0	750	0	750 USD	102.22%	650'483.28	0.33	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	0	860	860	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	0	1'050	50	1'000 USD	69.48%	589'540.18	0.30	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	0	2'800	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	0	1'350	200	1'150 USD	87.16%	850'398.79	0.43	a)
US912828ZCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	4'170	4'170	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PFG28	4.8000 % UNH 4.8 01/15/30	0	550	0	550 USD	102.03%	476'111.11	0.24	a)
US91324PFL13	5.6250 % UNH 5 5/8 07/15/54	0	500	0	500 USD	104.43%	443'005.44	0.22	a)
US92343VCV45	4.2720 % VZ 4.272 01/15/36	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	50	0	0	50 USD	71.78%	30'451.72	0.02	a)
US92343VGH15	2.1000 % VZ 2.1 03/22/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	800	0	500	300 USD	90.59%	230'578.17	0.12	a)
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	2'000	0	1'500	500 USD	59.64%	253'016.27	0.13	a)
US92928QAF54	3.5000 % URWFP 3 1/2 06/15/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	92.59%	785'613.79	0.40	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	1'200	0	0	1'200 USD	99.02%	1'008'192.77	0.51	a)
USU24652AT35	3.3500 % HOG 3.35 06/08/25 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	98.29%	1'167'470.59	0.59	a)
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	101'000	0	0	101'000 JPY	103.89%	611'428.05	0.31	a)
XS0785710046	4.8750 % T 4 7/8 06/01/44	500	0	0	500 GBP	90.10%	502'335.90	0.25	a)
XS1421915049	1.5000 % MMM 1 1/2 06/02/31 MTN	680	0	0	680 EUR	88.57%	565'610.42	0.28	a)
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	94.68%	1'333'715.28	0.67	a)
XS1499602289	1.0000 % BX 1 10/05/26 REGS	1'000	0	0	1'000 EUR	95.50%	896'919.71	0.45	a)
XS1627602201	1.8750 % AIG 1 7/8 06/21/27	1'850	0	668	1'182 EUR	96.39%	1'070'016.60	0.54	a)
XS1843434793	1.0000 % ITW 1 06/05/31	0	500	0	500 EUR	87.56%	411'151.98	0.21	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	100	0	0	100 EUR	97.80%	91'852.02	0.05	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	100	0	0	100 EUR	96.13%	90'277.06	0.05	a)
XS2033262622	1.0010 % JPM 1.001 07/25/31 EMTN	900	0	600	300 EUR	87.35%	246'099.52	0.12	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2052321093	1.5000 % VZ 1 1/2 09/19/39	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2058557260	1.5000 % TMO 1 1/2 10/01/39 EMTN	1'000	0	800	200 EUR	74.78%	140'467.30	0.07	a)
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	1'000	0	0	1'000 EUR	93.95%	882'287.70	0.44	a)
XS2091604715	0.3000 % CB 0.3 12/15/24	1'400	0	1'050	350 EUR	99.00%	325'400.23	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2091606330	0.8750 % CB 0 7/8 12/15/29	500	0	0	500 EUR	88.70%	416'491.07	0.21	a)
XS2115092012	1.2000 % IBM 1.2 02/11/40	700	0	500	200 EUR	71.50%	134'300.82	0.07	a)
XS2168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	950	0	950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2251337601	1.8750 % VZ 1 7/8 11/03/38	400	0	0	400 GBP	66.79%	297'899.09	0.15	a)
XS2282195176	0.6250 % ATH 0 5/8 01/12/28 GMTN	0	380	0	380 EUR	90.83%	324'163.27	0.16	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	500	0	0	500 EUR	80.26%	376'858.80	0.19	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	1'300	0	500	800 EUR	83.09%	624'244.02	0.31	a)
XS2464407860	2.5000 % NESNVX 2 1/2 04/04/32 EMTN	600	0	300	300 GBP	87.87%	293'951.72	0.15	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	1'000	0	340	660 EUR	103.56%	641'889.02	0.32	a)
XS2621007660	4.1250 % BKNG 4 1/8 05/12/33	500	0	0	500 EUR	104.44%	490'407.14	0.25	a)
XS2625194811	4.6250 % PLD 4 5/8 05/23/33	400	0	0	400 EUR	106.66%	400'684.18	0.20	a)
XS2680745382	4.6680 % NGGLN 4.668 09/12/33 EMTN	0	700	0	700 EUR	105.85%	695'885.46	0.35	a)
XS2726263911	4.1250 % MCD 4 1/8 11/28/35 GMTN	0	200	0	200 EUR	103.42%	194'258.25	0.10	a)
<b>US</b>							<b>81'154'789.08</b>	<b>40.88</b>	
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	630	0	630 EUR	101.99%	603'423.08	0.30	a)
US045167FM03	2.8750 % ASIA 2 7/8 05/06/25 GMTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458182BV36	7.0000 % IADB 7 06/15/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	3'000	0	1'900	1'100 USD	98.60%	920'191.54	0.46	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	740	0	0	740 USD	86.43%	542'672.18	0.27	a)
XS1505567088	0.8750 % EIB 0 7/8 09/13/47 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	65.35%	675'110.45	0.34	a)
XS2055744689	0.1500 % EUROF 0.15 10/10/34 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182121827	1.6250 % CAF 1 5/8 06/03/25	1'000	0	0	1'000 EUR	98.62%	926'202.51	0.47	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	700	0	700 EUR	95.75%	629'434.72	0.32	a)
<b>XS</b>							<b>4'297'034.48</b>	<b>2.16</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>1'778'517.87</b>	<b>0.90</b>	

#### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 06.09.2023	265'162	300'000	CHF/USD	0.00	0.00
<b>Devisentermingeschäfte</b>					<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

GBP/CHF	Verfall 07.09.2023	1'111'290	1'000'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023	670'831	1'022'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023	6'423'601	6'735'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023	235'888	38'600'000	CHF/JPY	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023	275'576	473'000	CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	15'967'650	18'490'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	140'000	122'445	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023	40'000	38'310	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 07.09.2023	50'000	55'502	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 07.09.2023	50'000	32'807	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	220'000	193'047	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	200'000	175'798	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023	90'000	85'906	EUR/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	53'010	60'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	175'203	200'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 07.09.2023	25'000	14'262	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023	3'700'000	22'280	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	120'000	105'998	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	16'008'249	18'070'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023	210'519	34'900'000	CHF/JPY	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023	253'315	448'000	CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023	6'276'454	6'605'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023	631'792	972'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023	1'056'711	950'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	400'000	354'440	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	80'000	76'052	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	170'000	151'304	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	50'000	47'748	EUR/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	133'464	150'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023	12'000'000	72'618	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023	100'000	56'915	AUD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	133'306	150'000	CHF/USD	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		200'000	178'478		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		100'000	89'300		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		40'000	38'339		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		40'000	26'665		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		300'000	271'367		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		50'000	48'257		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		80'000	73'016		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		50'000	48'341		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		90'000	82'701		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		60'000	54'966		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		30'000	29'056		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		20'000	22'367		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		220'000	202'680		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		60'000	57'873		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		15'136'054	16'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		139'500	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		1'030'329	930'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		5'985'745	6'245'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		201'811	348'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		619'554	932'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		200'000	180'768		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		20'000	22'188		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		207'063	230'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		124'204	130'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		235'184	260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		150'000	135'523		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		89'972	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		170'000	152'304		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		89'419	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		150'000	135'293		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		15'209'803	16'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		137'830	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		1'001'687	910'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		6'119'477	6'375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		609'151	932'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		200'046	348'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		220'000	199'669		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		25'000	23'965		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		32'974	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		271'022	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		12'424	19'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		107'467	120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		89'441	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		291'859	330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		163'485	170'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		27'492	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		12'924	20'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		79'440	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		174'901	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		15'315'772	17'690'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		1'058'052	965'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		134'944	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		6'169'935	6'520'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		200'030	348'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		620'433	971'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		86'549	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		75'674	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		121'827	140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		75'405	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		550'000	478'778		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		110'000	103'496		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		130'998	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		233'172	270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		85'537	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'120	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		24'224	22'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		172'894	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		171'050	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		150'492	160'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		30'283	28'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		4'036	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		15'399	24'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		375'962	450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		139'216	150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		320'000	272'700		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		120'000	111'556		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		15'577'824	18'330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		135'413	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		1'096'018	1'015'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		6'362'451	6'850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		636'224	1'003'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		201'830	355'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		380'000	329'756		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		190'000	179'033		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		35'000	38'514		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		25'000	16'081		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		100'000	86'785		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		129'341	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		46'828	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		30'000	32'862		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		94'282	110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		134'276	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		15'729'422	18'110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		199'773	355'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		6'259'135	6'710'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		627'690	978'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		1'033'287	950'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		450'000	390'929		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		130'000	121'297		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		139'003	160'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		200'000	174'543		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		230'000	203'393		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		50'000	47'688		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		140'000	123'859		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		80'000	76'721		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.03.2024		20'000	22'415		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		15'114'450	17'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		6'184'589	6'450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		1'042'355	930'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		136'081	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		636'091	978'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		205'996	355'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		130'000	113'938		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		70'000	67'151		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.04.2024		16'000	17'963		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.04.2024		60'000	39'055		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		134'077	140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		297'645	340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		230'000	203'446		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		100'000	96'377		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		250'000	224'455		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		90'000	87'826		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		270'000	244'494		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		108'192	120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		15'179'314	16'830'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		1'042'751	914'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		136'677	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		6'203'641	6'330'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		609'800	918'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		211'511	355'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		460'000	414'975		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		150'000	147'037		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		35'000	39'961		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2024		45'000	29'923		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		236'308	260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		166'342	170'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		170'000	154'458		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		60'000	58'167		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		27'198	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		160'000	146'185		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		90'000	87'870		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		289'396	320'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		97'368	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		15'027'940	16'618'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		145'420	24'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		1'018'264	899'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		6'136'192	6'311'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		223'307	374'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		588'647	893'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		90'180	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.06.2024		90'000	89'204	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2024		200'000	182'619	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2024		100'000	90'306	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		179'152	200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		135'519	140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		177'893	200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		141'901	24'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		15'073'166	16'818'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		1'024'393	899'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		581'439	893'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		6'121'419	6'361'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		221'264	374'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		38'486	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		186'426	210'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		85'491	90'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		50'000	47'741	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		97'034	110'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		80'000	71'088	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		130'000	116'091	USD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		14'378	22'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		11'857	20'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		130'000	116'482	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		170'000	153'554	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		90'000	87'259	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		50'000	48'502	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		200'000	180'536	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		30'000	34'330	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.07.2024		20'000	13'185	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		89'944	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		134'499	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		14'846'813	16'558'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		133'125	23'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		1'006'338	875'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		6'094'014	6'271'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		595'630	904'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		234'164	387'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		98'067	110'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		185'630	210'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		106'396	110'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		120'000	106'547	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		79'066	90'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		19'232	17'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		14'627	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		66'790	70'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		5'759	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		131'948	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		57'125	60'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		75'044	80'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		274'790	320'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		466'712	550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		121'129	130'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		18'395	30'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		32'479	30'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		110'000	93'788	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		140'478	23'900'000	CHF/JPY		1'158.38	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		15'053'835	17'468'000	CHF/USD		256'699.64	0.13	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		992'589	905'000	CHF/GBP		-15'054.58	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		6'233'864	6'606'000	CHF/EUR		35'909.97	0.02	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		601'601	957'500	CHF/CAD		-449.16	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		224'488	397'000	CHF/AUD		-3'768.82	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 13.09.2024		70'000	60'324	USD/CHF		-1'027.49	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 13.09.2024		25'000	23'534	EUR/CHF		-77.95	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		128'219	150'000	CHF/USD		1'154.60	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		119'128	140'000	CHF/USD		535.06	0.00	b)
<b>Klasse A hedged</b>							<b>275'079.65</b>	<b>0.14</b>	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		239'582	365'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		396'731	357'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		2'334'814	2'448'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		96'131	165'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		85'555	14'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		5'803'278	6'720'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		50'000	43'750		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		15'000	16'671		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		15'000	14'385		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		15'000	9'863		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		80'000	70'214		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		60'000	52'758		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		30'000	28'656		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		44'170	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		61'304	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		1'200'000	7'246		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		80'000	70'675		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		77'211	12'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		5'820'376	6'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		93'297	165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		227'497	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		380'416	342'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		2'283'470	2'403'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		30'000	28'538		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		150'000	132'918		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		60'000	53'420		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'117		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		53'367	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		4'300'000	26'041		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		53'304	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		38'000	21'646		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	26'796		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		80'000	71'446		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		110'000	99'511		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		25'000	24'143		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	27'587		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		10'000	9'186		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'381		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		90'000	82'914		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'291		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		51'780	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		378'895	342'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		2'193'016	2'288'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		5'539'344	6'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		232'665	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		73'650	127'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		70'000	63'286		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		8'000	8'893		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		15'000	10'002		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		85'513	95'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		72'348	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		38'196	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		55'000	49'711		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		35'971	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		70'000	62'731		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		17'823	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		26'805	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		60'000	54'135		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		5'568'765	6'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		51'160	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		367'652	334'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		2'234'689	2'328'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		218'955	335'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		73'005	127'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		80'000	72'623		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		99'365	110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		12'071	11'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		8'491	13'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		53'718	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'758	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		13'180	12'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		114'968	130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		67'301	70'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'799	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		52'950	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		61'197	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'653'589	6'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		50'089	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		391'424	357'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		2'269'249	2'398'000		CHF/EUR	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		228'110	357'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		72'999	127'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		51'917	60'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		37'822	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		39'138	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		28'258	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		110'000	95'767	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		43'646	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		69'071	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		18'985	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		13'199	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'764	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		69'141	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		64'127	75'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		56'416	60'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		10'796	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'756	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		3'455	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		55'668	60'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		150'385	180'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		120'000	102'272	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		40'000	37'205	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		40'000	37'237	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		70'000	59'332	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		5'779'007	6'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		50'262	8'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		409'252	379'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		2'348'070	2'528'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		237'870	375'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		75'615	133'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		130'000	112'819	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		15'000	16'523	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		50'000	47'134	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		12'000	7'734	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		15'000	13'043	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		47'406	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		23'399	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		10'000	10'974	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		38'552	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		385'035	354'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		5'867'049	6'755'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		49'841	8'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		2'334'816	2'503'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		74'845	133'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		232'977	363'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		180'000	156'372	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		55'000	51'335	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		60'797	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		50'000	43'657	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		90'000	79'602	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		70'000	61'580	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		30'000	28'625	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		50'000	44'255	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		30'000	28'789	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.03.2024		10'000	11'222	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		5'594'537	6'385'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		2'289'736	2'388'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		385'559	344'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		77'176	133'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		50'510	8'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		236'095	363'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		35'000	30'698	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		20'000	19'207	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.04.2024		5'000	5'634	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.04.2024		22'000	14'339	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		47'865	50'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		113'799	130'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		110'000	97'310	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		45'000	43'386	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		90'000	80'817	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		35'000	34'173	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		75'000	67'932	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		45'062	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		386'753	339'000	CHF/GBP		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		50'732	8'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		5'641'510	6'255'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		2'291'329	2'338'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		226'516	341'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		79'242	133'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		180'000	162'381	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		13'000	14'862	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		45'000	44'132	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2024		17'000	11'323	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		90'876	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		63'585	65'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		65'000	59'076	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		55'000	53'323	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		80'000	72'877	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		18'122	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		60'000	54'838	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		28'000	27'358	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		90'424	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		29'189	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		5'500'165	6'075'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		369'850	329'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		53'048	9'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		2'214'792	2'307'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		210'491	326'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		80'987	137'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		36'054	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.06.2024		35'000	34'709	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2024		80'000	73'063	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		22'488	23'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		62'686	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		43'539	45'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		75'590	85'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		52'069	9'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		5'547'800	6'190'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		374'889	329'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		2'251'866	2'340'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		212'261	326'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		81'051	137'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		30'000	26'893	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		71'019	80'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		37'996	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		20'000	19'096	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		26'464	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		25'000	22'215	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		40'000	38'251	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		130'000	116'091	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		45'000	40'321	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		65'000	58'712	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		30'000	29'086	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		45'000	40'621	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		15'000	17'165	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		27'007	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		26'983	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		50'000	44'851	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		20'000	19'439	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		5'321'647	5'935'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		361'204	314'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		47'708	8'565'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		2'186'498	2'250'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		213'579	324'200	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		83'891	138'700	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		49'033	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		61'877	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		43'526	45'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		50'000	44'394	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		35'140	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		19'083	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		6'788	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		5'723	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		48'381	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		19'042	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		77'285	90'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		22'513	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		165'471	195'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EUR/CHF	Verfall 09.08.2024		41'929	45'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 09.08.2024		14'074	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 09.08.2024		7'971	13'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 09.08.2024		40'000	34'105	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.09.2024		5'390'528	6'255'000	CHF/USD		91'919.87	0.05	b)
GBP/CHF	Verfall 13.09.2024		355'358	324'000	CHF/GBP		-5'389.71	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 13.09.2024		2'232'716	2'366'000	CHF/EUR		12'861.49	0.01	b)
JPY/CHF	Verfall 13.09.2024		50'343	8'565'000	CHF/JPY		415.12	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 13.09.2024		212'536	338'200	CHF/CAD		-114.70	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 13.09.2024		81'806	144'700	CHF/AUD		-1'389.58	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 13.09.2024		25'000	21'544	USD/CHF		-366.96	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 13.09.2024		10'000	9'413	EUR/CHF		-31.18	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 13.09.2024		55'562	65'000	CHF/USD		500.32	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 13.09.2024		42'546	50'000	CHF/USD		191.10	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 13.09.2024		90'000	76'239	USD/CHF		-0.21	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 13.09.2024		20'000	18'954	EUR/CHF		-189.57	0.00	b)
<b>Klasse B hedged</b>							<b>98'405.99</b>	<b>0.05</b>	
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023		65'253	112'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023		57'200	9'360'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		3'920'667	4'540'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		1'571'803	1'648'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		266'710	240'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023		160'816	245'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		50'000	43'750	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023		10'000	9'600	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 07.09.2023		10'000	11'124	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 07.09.2023		10'000	6'585	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		60'000	52'668	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		40'000	35'182	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023		20'000	19'114	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		35'330	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		43'780	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023		800'000	4'841	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		20'000	17'691	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023		1'537'517	1'618'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023		63'329	112'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023		255'835	230'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023		152'748	235'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.10.2023		3'951'123	4'460'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023		51'635	8'560'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		100'000	88'622	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		40'000	35'624	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		20'000	19'117	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.10.2023		35'568	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.10.2023		35'526	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023		2'800'000	16'967	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023		26'000	14'820	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		30'000	26'811	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		70'000	63'336	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		25'000	22'838	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		15'000	14'523	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		20'000	18'401	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		80'000	73'278	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		30'000	29'056	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		15'000	14'468	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		60'000	55'276	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		3'718'499	4'115'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		254'813	230'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		35'088	5'760'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		1'474'151	1'538'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023		156'218	235'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023		49'873	86'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		45'000	40'695	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.11.2023		6'000	6'677	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.11.2023		9'000	6'013	CAD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		53'997	60'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		28'639	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		63'301	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		40'000	36'161	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		22'471	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		40'000	35'859	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		22'332	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		40'000	36'100	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		3'745'765	4'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		34'668	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		246'569	224'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'505'151	1'568'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		147'713	226'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		49'437	86'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		50'000	45'400		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		63'221	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		8'771	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'214	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'802	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		26'811	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		75'161	85'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		43'254	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		8'777	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'856	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'290	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		43'704	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		3'805'134	4'395'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		33'942	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		263'142	240'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'526'396	1'613'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		153'351	240'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		49'433	86'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		34'601	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		28'359	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		30'434	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		18'829	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		85'000	74'008		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		30'543	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		60'434	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		14'231	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		9'892	9'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		4'476	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		51'849	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		38'464	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		37'601	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		7'548	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		3'827	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		1'712	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		100'247	120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		37'102	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		75'000	63'931		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		25'000	23'265		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		45'000	38'153		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		25'000	23'285		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		3'905'079	4'595'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		34'060	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		276'434	256'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		1'586'433	1'708'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		160'483	253'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		50'600	89'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		90'000	78'115		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		35'000	33'003		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		10'000	11'025		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		8'000	5'166		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		10'000	8'706		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		18'713	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		34'469	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		7'000	7'691		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		23'977	28'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		3'963'189	4'563'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		33'774	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		259'953	239'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		1'579'242	1'693'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		157'243	245'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		50'084	89'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		100'000	86'886		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		30'000	28'015		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		43'418	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		35'000	30'569		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		60'000	53'078		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		30'000	26'565		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		20'000	19'203		EUR/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		3'844'766	4'388'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		1'575'392	1'643'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		267'874	239'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		34'228	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		159'348	245'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		51'644	89'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		25'000	21'935		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		18'000	17'290		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.04.2024		6'000	6'755		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.04.2024		11'000	7'184		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		74'397	85'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		33'496	35'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		45'000	39'827		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		20'000	19'299		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		65'000	58'377		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		25'000	24'418		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		50'000	45'298		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		28'829	32'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		3'896'294	4'320'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		34'378	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		265'822	233'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		1'582'761	1'615'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		155'439	234'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		53'027	89'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		30'000	29'431		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		120'000	108'263		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		7'000	8'016		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2024		10'000	6'673		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		44'011	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		59'059	65'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		42'000	38'183		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		15'000	14'564		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		989'088	1'090'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		397'233	410'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		12'919	2'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		67'685	60'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		40'961	62'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		17'465	30'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		55'000	50'021		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		21'000	20'462		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		40'000	36'569		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		22'000	21'502		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		81'379	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		23'346	24'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		4'790'567	5'292'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		46'389	7'890'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		324'371	286'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		71'239	119'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		188'294	285'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		1'944'737	2'010'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		36'054	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2024		65'000	59'369		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.06.2024		27'000	26'782		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		18'572	19'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		53'727	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		66'694	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		38'698	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		4'841'553	5'402'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		45'145	7'890'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		325'891	286'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		1'965'090	2'042'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		185'566	285'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		70'402	119'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		9'621	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		20'000	17'929		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		27'547	29'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		68'356	77'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		15'000	14'322		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		35'285	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		25'000	22'215		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		40'000	35'720		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		5'656	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		5'882	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		4'150	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		40'000	35'841	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		55'000	49'679	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		30'000	29'086	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		40'000	36'107	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		10'000	11'443	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		27'007	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		22'486	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		49'316	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		19'431	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		4'818'624	5'374'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		43'215	7'760'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		326'629	284'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		1'978'538	2'036'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		76'224	126'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		193'643	294'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		44'576	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		57'457	65'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		38'689	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		40'000	35'516	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		26'355	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		19'083	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		6'788	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		5'088	8'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		19'042	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		43'983	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		94'459	110'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		28'141	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		152'742	180'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		41'929	45'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		14'074	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		9'197	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		40'000	34'105	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		4'906'199	5'693'000	CHF/USD		83'661.05	0.04	b)
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		45'611	7'760'000	CHF/JPY		376.12	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		323'551	295'000	CHF/GBP		-4'907.29	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		2'031'715	2'153'000	CHF/EUR		11'703.63	0.01	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		193'558	308'000	CHF/CAD		-104.46	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		74'061	131'000	CHF/AUD		-1'258.02	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 13.09.2024		25'000	21'544	USD/CHF		-366.96	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 13.09.2024		10'000	9'413	EUR/CHF		-31.18	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		55'562	65'000	CHF/USD		500.32	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		38'291	45'000	CHF/USD		171.99	0.00	b)
<b>Klasse It hedged</b>							<b>89'745.20</b>	<b>0.05</b>	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		5'311'966	4'780'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		3'197'932	4'872'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		1'285'246	2'206'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		31'254'846	32'770'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		77'601'568	89'860'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		1'136'665	186'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	524'744	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		150'000	166'448	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		130'000	85'250	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		200'000	191'437	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		900'000	789'737	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	527'393	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		210'000	200'419	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		530'293	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		15'000'000	90'232	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		876'015	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		300'000	264'974	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		1'031'484	171'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		3'082'262	4'742'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		78'898'432	89'060'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		5'150'074	4'630'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		30'750'349	32'360'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		1'247'350	2'206'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		2'000'000	1'772'198	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		180'000	171'084	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		800'000	712'017	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		250'000	238'638	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		622'845	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		55'000'000	332'761	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		490'000	278'796	AUD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		533'235	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		400'000	357'152	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		1'400'000	1'266'380	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		900'000	821'258	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		500'000	483'209	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		500'000	459'376	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		1'200'000	1'105'526	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		400'000	385'820	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		75'147'118	83'160'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		706'638	116'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		5'129'489	4'630'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		29'741'821	31'030'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'152'278	4'742'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		995'139	1'716'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		900'000	813'458	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		90'000	99'741	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		162'000	107'726	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'080'330	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'266'376	1'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		668'818	700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		800'000	722'771	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		449'922	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		900'000	806'315	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		981'708	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		189'235	200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		357'724	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		2'600'000	2'345'034	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		500'000	478'916	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		74'879'030	82'560'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		698'177	116'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		4'997'428	4'540'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		30'170'223	31'430'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		2'993'470	4'580'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		986'434	1'716'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		1'200'000	1'089'102	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		180'000	172'363	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'174'429	1'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		58'964	90'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		87'980	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		806'063	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		447'265	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'547'737	1'750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		865'508	900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		187'110	170'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		77'691	120'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		662'116	750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		874'506	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		75'808'310	87'560'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		683'561	116'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		5'251'885	4'790'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		30'423'834	32'150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		3'060'633	4'790'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		986'355	1'716'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		605'932	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		473'060	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		329'961	350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		565'653	650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		1'600'000	1'392'808	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		611'337	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'209'039	1'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		475'275	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		187'378	170'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		83'662	130'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		950'919	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		855'251	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		752'459	800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		151'535	140'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		40'625	70'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		77'116	120'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		2'088'680	2'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		788'899	850'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		550'000	511'266	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		1'600'000	1'363'498	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		800'000	677'877	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		550'000	511'705		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		77'855'125	91'610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		685'934	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		5'507'087	5'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		3'196'978	5'040'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		31'626'491	34'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		1'015'404	1'786'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		1'700'000	1'475'226		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		650'000	612'481		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		180'000	197'956		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		140'000	89'914		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		300'000	260'316		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		172'419	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		94'017	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		603'611	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		281'093	300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		4'800'000	4'144'032		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		1'800'000	1'678'545		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		210'000	134'787		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		400'000	437'847		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		3'300'000	2'829'965		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		1'400'000	1'304'362		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		170'000	185'653		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		210'000	134'804		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		430'598	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		72'011'398	82'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		680'176	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		4'731'365	4'350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		2'875'309	4'480'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		28'543'894	30'600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		1'005'055	1'786'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		2'000'000	1'737'464		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		450'000	419'855		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		781'910	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		550'000	479'993		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		1'100'000	972'751		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		500'000	442'340		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		350'000	335'586		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.03.2024		70'000	78'377		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		69'798'092	79'660'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		28'573'760	29'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		4'797'075	4'280'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		689'318	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		2'913'792	4'480'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		1'036'362	1'786'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		850'000	744'938		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		400'000	383'622		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.04.2024		70'000	78'488		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.04.2024		250'000	162'636		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.04.2024		100'000	58'059		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		574'627	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		1'400'682	1'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		1'000'000	875'900		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		250'000	239'333		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		1'200'000	1'061'459		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		600'000	578'195		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		850'000	763'147		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		350'000	341'500		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		650'000	588'598		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		721'334	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		69'907'819	77'510'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		692'339	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		4'803'042	4'210'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		28'225'094	28'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		2'809'862	4'230'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		1'004'531	1'686'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		2'200'000	1'984'662		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		350'000	343'087		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		165'000	188'285		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2024		210'000	139'534		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		1'181'539	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		831'711	850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		700'000	636'005		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		300'000	290'744		EUR/CHF	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		272'226	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		300'000	292'862		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		700'000	639'552		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		904'362	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		292'138	300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		69'022'785	76'385'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		671'292	113'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		4'687'224	4'134'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		28'188'074	29'009'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		2'713'333	4'109'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		1'026'878	1'718'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		541'151	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2024		720'000	657'428		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.06.2024		300'000	297'308		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		722'040	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		548'148	560'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		806'186	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		978'414	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		152'333	134'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		629'208	650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		84'507	130'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		50'249	85'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		651'715	113'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		70'862'164	79'065'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		4'863'301	4'268'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		28'792'131	29'919'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		2'760'047	4'239'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		1'066'682	1'803'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		400'000	358'573		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		479'700	505'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		1'012'026	1'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		220'000	210'061		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		264'637	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		550'000	488'731		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		200'000	190'716		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		1'963'808	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		994'132	1'040'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		113'120	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		111'104	170'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		59'284	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		850'000	761'613		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		900'000	812'935		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		500'000	484'773		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		2'600'000	2'346'968		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		250'000	286'081		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		900'000	873'040		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.07.2024		160'000	105'482		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.07.2024		90'000	54'146		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		360'088	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		359'777	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		806'992	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		437'207	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		70'571'232	78'705'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		632'485	113'550'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		4'782'120	4'158'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		29'001'713	29'844'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		2'830'973	4'299'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		1'112'293	1'839'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		713'214	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		883'953	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		580'342	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		600'000	532'733		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		439'254	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		305'325	320'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		124'445	110'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		89'031	140'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		747'703	850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		304'666	320'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		1'373'949	1'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		440'883	470'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		2'291'134	2'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		559'058	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		216'528	200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		122'630	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		550'000	468'942		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		71'921'102	83'455'000		CHF/USD	1'226'406.50	0.62	b)
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		667'415	113'550'000		CHF/JPY	5'503.52	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		4'735'909	4'318'000		CHF/GBP	-71'829.50	-0.04	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		2'836'751	4'514'000		CHF/CAD	-1'530.90	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		29'776'469	31'554'000		CHF/EUR	171'526.39	0.09	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		1'090'562	1'929'000		CHF/AUD	-18'524.62	-0.01	b)
	CHF/EUR Verfall 13.09.2024		100'000	94'135		EUR/CHF	-311.78	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 13.09.2024		300'000	258'533		USD/CHF	-4'403.53	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		683'835	800'000		CHF/USD	6'157.83	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		510'550	600'000		CHF/USD	2'293.12	0.00	b)
<b>Klasse Nt hedged</b>							<b>1'315'287.03</b>	<b>0.66</b>	
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>1'778'517.87</b>	<b>0.90</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'072'244.20	0.54
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	193'507'320.23	97.47
Derivative Finanzinstrumente	1'778'517.87	0.90
Sonstige Vermögenswerte	2'172'584.32	1.09
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>198'530'666.62</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-44'901.27	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>198'485'765.35</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	193'507'320.23	97.47
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	1'778'517.87	0.90
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	0.57567333
CAD	1 = CHF	0.62953070
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
JPY	100 = CHF	0.58270700
USD	1 = CHF	0.84845000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	587'669.81	0.296
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	150'231'648.87	75.689

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

Periode: 01.09.2023 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
A	CHF	0.20	-	0.20	-
A hedged	CHF	0.20	-	0.20	-
B	CHF	0.20	-	0.20	-
B hedged	CHF	0.20	-	0.20	-
It	CHF	0.20	-	0.20	-
It hedged	CHF	0.20	-	0.20	-
Nt	CHF	0.20	-	0.20	-
Nt hedged	CHF	0.20	-	0.20	-

## 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.

Die Währungsbesicherung der Anlagen und allfälligen Guthaben und Forderungen, die nicht auf die Rechnungseinheit des Teilvermögens lauten, ist per 05.08.2024 unvollständig. Die Verletzung wurde zeitnah behoben. Infolge des Verstosses entstand dem Fonds ein Verlust von CHF 2'120.68. Die Entschädigung des Fonds ist erfolgt.

## 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:** 01.09.2023 - 31.08.2024

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 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Ja	CHF	2.05000	0.71750	1.33250
A hedged	Ja	CHF	2.00000	0.70000	1.30000

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Ja	CHF	2.286	0.800	1.486
B hedged	Ja	CHF	2.209	0.773	1.436
It	Ja	CHF	2.919	1.021	1.898
It hedged	Ja	CHF	2.770	0.969	1.801
Nt	Ja	CHF	3.322	1.162	2.160
Nt hedged	Ja	CHF	3.117	1.090	2.027

## 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.