



BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL STAATSANLEIHEN

Jahresbericht per 31.08.2023

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

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

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 20.12.2023

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

BEKB Obligationenfonds,

mit den Teilvermögen

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

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	26
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	26
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	27
7	Verwaltungskommission	27
8	Benchmark	27
9	TER	27
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	28
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	28
12	Fussnoten	28
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	29
14	Pflichtpublikationen	31

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020	01.09.2019
	bis	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021	31.08.2020
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		260'896'961.29	276'139'609.54	296'113'775.84	336'308'162.58
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		537'467.68	669'814.29	939'798.31	906'199.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'859.000	8'474.000	10'034.000	9'526.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		68.39	79.04	93.66	95.13
Ausschüttung je Anteil		1.10	1.65	1.40	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
Klasse A hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'666'802.93	1'945'353.48	2'284'009.12	2'446'451.79
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		22'476.683	24'382.783	25'048.000	25'943.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.16	79.78	91.19	94.30
Ausschüttung je Anteil		1.15	1.45	1.40	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		94'816.19	107'940.11	100'750.52	157'023.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000	1'011.000	1'569.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.60	84.93	99.65	100.08
Thesaurierung je Anteil		1.22	1.57	1.55	1.61
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
Klasse B hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'281'189.59	1'392'814.63	1'866'746.86	1'862'676.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'000.000	16'358.000	19'370.000	18'870.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.07	85.15	96.37	98.71
Thesaurierung je Anteil		1.20	1.50	1.46	1.48
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		77.30	87.80	102.46	102.36
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1.000	1.000	1.000	1.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.30	87.80	102.46	102.36
Thesaurierung je Anteil		1.65	2.45	2.53	2.50
Total Expense Ratio (TER)		0.22 %	0.23 %	0.23 %	0.23 %
Klasse It hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'499'606.44	5'815'524.49	5'786'196.82	3'149'799.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		66'380.000	66'380.000	58'680.000	31'247.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.85	87.61	98.61	100.80
Thesaurierung je Anteil		1.72	2.07	2.05	2.08
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %

	von	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020	01.09.2019
	bis	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021	31.08.2020
Klasse Nt	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		71'339'480.42	80'786'090.22	90'787'253.77	92'970'192.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		891'465.961	890'922.741	857'492.070	878'714.039
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.02	90.68	105.88	105.80
Thesaurierung je Anteil		1.95	2.43	2.46	2.54
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %
Klasse Nt hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		180'477'520.74	185'421'984.52	194'348'917.98	234'815'718.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'149'529.356	2'093'419.820	1'954'543.301	2'318'250.718
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.96	88.57	99.43	101.29
Thesaurierung je Anteil		1.95	2.33	2.32	2.34
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

Performance

	YTD / 31.08.2023	2022	2021	2020
Klasse A	-11.56 %	-16.36 %	-4.16 %	-1.19 %
Klasse A hedged	-5.29 %	-13.62 %	-3.48 %	1.95 %
Klasse B	-11.57 %	-16.36 %	-4.15 %	-1.19 %
Klasse B hedged	-5.37 %	-13.66 %	-3.53 %	1.94 %
Klasse It	-11.06 %	-15.69 %	-3.28 %	-0.41 %
Klasse It hedged	-4.63 %	-12.92 %	-2.94 %	2.32 %
Klasse Nt	-10.89 %	-15.72 %	-3.41 %	-0.43 %
Klasse Nt hedged	-4.31 %	-12.64 %	-2.64 %	2.76 %
Benchmark Hedge	-3.97 %	-13.22 %	-	-
Benchmark	-10.53 %	-16.20 %	-3.73 %	-0.05 %
Tracking Error 33)	0.44 %	0.56 %	0.43 %	0.62 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse A	-1.03 %
Klasse A hedged	-1.32 %
Klasse B	-1.04 %
Klasse B hedged	-1.40 %
Klasse It	-0.53 %
Klasse It hedged	-0.66 %
Klasse Nt	-0.36 %
Klasse Nt hedged	-0.34 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2023	31.08.2022
Bankguthaben auf Sicht	2'012'493.34	8'924'995.43
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	258'556'158.21	265'113'925.13
Derivative Finanzinstrumente	-1'211'390.72	1'737.52
Sonstige Vermögenswerte	1'549'941.87	2'111'074.14
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	260'907'202.70	276'151'732.22
Andere Verbindlichkeiten	-10'241.41	-12'122.68
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	260'896'961.29	276'139'609.54

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Klasse A			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'474.000	10'034.000
Zurückgenommene Anteile		-615.000	-1'560.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'859.000	8'474.000
Klasse A hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		24'382.783	25'048.000
Ausgegebene Anteile		-	554.783
Zurückgenommene Anteile		-1'906.100	-1'220.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		22'476.683	24'382.783
Klasse B			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'271.000	1'011.000
Ausgegebene Anteile		-	260.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000
Klasse B hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'358.000	19'370.000
Ausgegebene Anteile		-	468.000
Zurückgenommene Anteile		-358.000	-3'480.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		16'000.000	16'358.000
Klasse It			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1.000	1.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1.000	1.000
Klasse It hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		66'380.000	58'680.000
Ausgegebene Anteile		-	7'700.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		66'380.000	66'380.000
Klasse Nt			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		890'922.741	857'492.070
Ausgegebene Anteile		45'111.898	78'909.114
Zurückgenommene Anteile		-44'568.678	-45'478.443
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		891'465.961	890'922.741
Klasse Nt hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'093'419.820	1'954'543.301
Ausgegebene Anteile		318'726.198	315'421.215
Zurückgenommene Anteile		-262'616.662	-176'544.696
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'149'529.356	2'093'419.820

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		276'139'609.54	296'113'775.84
Ausbezahlte Ausschüttung		-49'315.46	-47'469.50
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'556'601.67	-2'367'595.66
Saldo aus dem Anteilverkehr		4'757'906.78	14'913'421.26
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-17'394'637.90	-32'472'522.40
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		260'896'961.29	276'139'609.54

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2022 31.08.2023	01.09.2021 31.08.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		18'511.45	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-5'449.57	-24'101.84
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		6'212'810.59	7'026'353.17
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		316'875.82	651'060.95
Total Ertrag		6'542'748.29	7'653'312.28
Aufwand			
Passivzinsen		-1'659.35	-1'870.09
Reglementarische Vergütungen		-125'387.86	-137'358.08
Sonstige Aufwendungen		0.00	-348.25
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-288'727.13	-247'777.95
Total Aufwand		-415'774.34	-387'354.37
Nettoertrag / Verlust		6'126'973.95	7'265'957.91
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-26'902'824.84	1'563'323.72
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		70'285.13	87'818.19
Realisierter Erfolg		-20'705'565.76	8'917'099.82
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		3'310'927.86	-41'389'622.22
Gesamterfolg		-17'394'637.90	-32'472'522.40

Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	8'858.46	12'189.07
Vortrag des Vorjahres	2.55	1'795.58
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8'861.01	13'984.65
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	8'644.90	13'982.10
Vortrag auf neue Rechnung	216.11	2.55
Total	8'861.01	13'984.65
Klasse A hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	25'154.07	34'475.91
Vortrag des Vorjahres	832.53	1'711.66
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	25'986.60	36'187.57
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	25'848.19	35'355.04
Vortrag auf neue Rechnung	138.41	832.53
Total	25'986.60	36'187.57
Klasse B	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	1'555.15	2'004.46
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'555.15	2'004.46
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	544.30	701.56
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'010.85	1'302.90
Total	1'555.15	2'004.46
Klasse B hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	19'314.93	24'658.53
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	19'314.93	24'658.53
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	6'760.23	8'630.49
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	12'554.70	16'028.04
Total	19'314.93	24'658.53
Klasse It	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	1.65	2.45
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1.65	2.45
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.58	0.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1.07	1.59
Total	1.65	2.45
Klasse It hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	114'516.86	137'882.29
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	114'516.86	137'882.29
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	40'080.90	48'258.80
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	74'435.96	89'623.49
Total	114'516.86	137'882.29
Klasse Nt	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	1'746'544.49	2'171'799.81
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'746'544.49	2'171'799.81
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	611'290.57	760'129.93
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'135'253.92	1'411'669.88
Total	1'746'544.49	2'171'799.81
Klasse Nt hedged	31.08.2023	31.08.2022
Nettoertrag	4'211'028.34	4'882'945.39
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'211'028.34	4'882'945.39
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'473'859.92	1'709'030.89
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'737'168.42	3'173'914.50
Total	4'211'028.34	4'882'945.39

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							258'556'158.21	99.10	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							258'556'158.21	99.10	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	2'800	0	2'800 AUD	80.26%	1'285'526.99	0.49	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	0	500	0	500 AUD	57.42%	164'223.20	0.06	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	900	1'300	0	2'200 AUD	103.87%	1'307'159.14	0.50	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	2'100	0	1'600	500 AUD	101.24%	289'570.78	0.11	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	0	800	0	800 AUD	87.53%	400'576.82	0.15	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	1'500	1'500	0	3'000 AUD	88.10%	1'511'859.10	0.58	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	2'500	0	1'500	1'000 AUD	79.38%	454'088.58	0.17	a)
AU3TB0000101	5.5000 % ACGB 5 1/2 04/21/23 133	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	800	500	120	1'180 AUD	99.22%	669'765.47	0.26	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	1'500	1'200	600	2'100 AUD	97.12%	1'166'728.67	0.45	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	500	0	0	500 AUD	99.01%	283'198.29	0.11	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	0	770	0	770 AUD	95.51%	420'678.14	0.16	a)
AU							7'953'375.18	3.05	
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	3'100	2'400	5'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	800	850	800	850 CAD	98.16%	544'703.04	0.21	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	0	700	550	150 CAD	85.79%	84'012.71	0.03	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	1'200	0	1'100	100 CAD	96.02%	62'685.65	0.02	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	0	1'080	850	230 CAD	74.61%	112'031.05	0.04	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	0	1'500	0	1'500 CAD	97.37%	953'494.80	0.37	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	0	600	550	50 CAD	69.24%	22'600.42	0.01	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	0	2'000	0	2'000 CAD	87.98%	1'148'776.65	0.44	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	900	90	800	190 CAD	113.81%	141'164.17	0.05	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	1'400	0	1'300	100 CAD	110.43%	72'089.05	0.03	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	300	300	100	500 CAD	117.54%	383'659.99	0.15	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	400	300	200	500 CAD	115.29%	376'312.35	0.14	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	0	1'300	0	1'300 CAD	106.22%	901'436.61	0.35	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	300	0	300	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA							4'802'966.49	1.84	
CND100010K57	3.6100 % CGB 3.61 06/07/25 1813	25'000	0	0	25'000 CNY	102.98%	3'124'139.57	1.20	a)
CND10001Q6Q0	4.0800 % CGB 4.08 10/22/48 1824	30'000	0	2'000	28'000 CNY	120.71%	4'101'333.08	1.57	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	30'000	0	0	30'000 CNY	104.30%	3'796'985.90	1.46	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	0	6'500	0	6'500 CNY	108.37%	854'807.23	0.33	a)
CND100031JZ0	1.9900 % CGB 1.99 04/09/25 INBK	15'000	0	0	15'000 CNY	99.75%	1'815'653.00	0.70	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	22'000	12'200	0	34'200 CNY	100.74%	4'180'900.21	1.60	a)
CND100036VL4	3.7300 % CGB 3.73 05/25/70 INBK	0	8'900	0	8'900 CNY	118.51%	1'279'942.38	0.49	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	0	8'000	0	8'000 CNY	102.80%	997'948.09	0.38	a)
CND10004GNL8	2.6900 % CGB 2.69 08/12/26 INBK	0	10'000	0	10'000 CNY	101.28%	1'229'001.97	0.47	a)
CND100058NN1	2.1800 % CGB 2.18 06/25/24 INBK	0	9'000	4'000	5'000 CNY	100.16%	607'693.22	0.23	a)
CND10005J69	2.6900 % CGB 2.69 08/15/32 INBK	0	13'200	9'200	4'000 CNY	100.48%	487'712.71	0.19	a)
CND10005L4G7	2.6000 % CGB 2.6 09/01/32 INBK	0	4'000	0	4'000 CNY	99.75%	484'193.55	0.19	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	0	4'000	0	4'000 CNY	102.31%	496'600.43	0.19	a)
CN							23'456'911.34	8.99	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	2'000	0	0	2'000 EUR	99.29%	1'903'565.95	0.73	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	3'000	0	2'000	1'000 EUR	94.62%	907'091.31	0.35	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	0	800	0	800 EUR	83.76%	642'386.64	0.25	a)
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	5'100	0	5'100 EUR	97.54%	4'768'730.36	1.83	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	5'500	0	5'000	500 EUR	120.67%	578'374.60	0.22	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	2'000	0	1'500	500 EUR	115.88%	555'439.20	0.21	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	1'600	0	1'200	400 EUR	121.01%	464'007.26	0.18	a)
DE							9'819'595.32	3.76	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	5'000	0	2'000	3'000 EUR	102.50%	2'947'751.96	1.13	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	750	1'700	2'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	4'400	1'800	4'000	2'200 EUR	109.38%	2'306'741.92	0.88	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	2'400	0	0	2'400 EUR	99.16%	2'281'288.19	0.87	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	0	1'300	0	1'300 EUR	84.63%	1'054'670.63	0.40	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	0	1'900	1'600	300 EUR	87.88%	252'738.00	0.10	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	0	2'500	0	2'500 EUR	67.10%	1'608'066.02	0.62	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	0	1'100	0	1'100 EUR	46.47%	490'047.68	0.19	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	0	1'600	0	1'600 EUR	80.46%	1'234'172.58	0.47	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	0	2'300	0	2'300 EUR	64.12%	1'413'737.79	0.54	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	0	300	0	300 EUR	93.58%	269'136.44	0.10	a)
ES							13'858'351.21	5.31	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	5'100	0	2'000	3'100 EUR	113.72%	3'379'592.15	1.30	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	0	400	0	400 EUR	110.72%	424'561.26	0.16	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	2'000	0	0	2'000 EUR	98.26%	1'883'837.19	0.72	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	7'000	0	2'000	5'000 EUR	91.94%	4'406'759.48	1.69	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	2'500	0	0	2'500 EUR	81.94%	1'963'696.47	0.75	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	0	500	0	500 EUR	64.32%	308'283.35	0.12	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	0	3'000	0	3'000 EUR	92.54%	2'661'483.71	1.02	a)
FR							15'028'213.61	5.76	
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	700	200	0	900 GBP	99.91%	1'006'342.36	0.39	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	600	450	0	1'050 GBP	100.08%	1'176'157.90	0.45	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'200	1'600	1'500	1'300 GBP	102.26%	1'487'797.51	0.57	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	2'300	200	1'500	1'000 GBP	98.96%	1'107'615.22	0.42	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	1'500	0	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	690	1'500	0	2'190 GBP	100.88%	2'472'590.82	0.95	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	1'630	700	530	1'800 GBP	81.79%	1'647'703.55	0.63	a)
GB00BFWVFP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	3'600	0	1'500	2'100 GBP	57.66%	1'355'112.90	0.52	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	0	1'800	0	1'800 GBP	93.70%	1'887'740.57	0.72	a)
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	0	3'000	0	3'000 GBP	64.08%	2'151'670.49	0.82	a)
GB							14'292'731.32	5.48	
XS2309433899	1.7500 % CROATI 1 3/4 03/04/41	0	400	0	400 EUR	70.63%	270'822.69	0.10	a)
HR							270'822.69	0.10	
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	0	2'000	0	2'000 EUR	83.70%	1'604'662.86	0.62	a)
IE							1'604'662.86	0.62	
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	0	500	0	500 EUR	107.36%	514'606.05	0.20	a)
IT0004898034	4.5000 % BTPS 4 1/2 05/01/23 10Y	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	0	500	0	500 EUR	69.15%	331'468.00	0.13	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	0	4'000	2'000	2'000 EUR	96.17%	1'843'785.33	0.71	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	3'000	2'000	1'000	4'000 EUR	86.17%	3'304'345.84	1.27	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	0	3'900	0	3'900 EUR	95.58%	3'573'435.31	1.37	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	5'200	0	3'700	1'500 EUR	69.61%	1'001'018.58	0.38	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	2'000	1'000	0	3'000 EUR	73.53%	2'114'514.07	0.81	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	4'200	900	4'600	500 EUR	93.10%	446'245.63	0.17	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	0	500	0	500 EUR	57.23%	274'304.46	0.11	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	0	4'600	0	4'600 EUR	78.33%	3'454'054.30	1.32	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	0	500	0	500 EUR	99.96%	479'131.68	0.18	a)
IT							17'336'909.25	6.64	
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	750'000	1'020'000	50'000	1'720'000 JPY	100.23%	10'458'546.90	4.01	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	0	300'000	0	300'000 JPY	99.49%	1'810'696.64	0.69	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	500'000	0	500'000 JPY	98.38%	2'984'399.11	1.14	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	1'200'000	540'000	450'000	1'290'000 JPY	104.52%	8'179'971.54	3.14	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	1'600'000	0	420'000	1'180'000 JPY	107.07%	7'665'222.38	2.94	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	1'100'000	0	0	1'100'000 JPY	112.00%	7'474'087.12	2.86	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	100'000	0	0	100'000 JPY	106.88%	648'442.41	0.25	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	0	80'000	0	80'000 JPY	94.94%	460'802.90	0.18	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	0	50'000	0	50'000 JPY	87.59%	265'696.85	0.10	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	750'000	140'000	510'000	380'000 JPY	118.37%	2'728'858.86	1.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	650'000	30'000	50'000	630'000 JPY	112.22%	4'289'136.92	1.64	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	250'000	240'000	50'000	440'000 JPY	105.51%	2'816'495.23	1.08	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	675'000	0	50'000	625'000 JPY	113.89%	4'318'381.50	1.66	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	0	200'000	0	200'000 JPY	107.25%	1'301'337.92	0.50	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	0	40'000	0	40'000 JPY	69.27%	168'111.37	0.06	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	0	65'000	0	65'000 JPY	80.38%	316'961.55	0.12	a)
JP							55'887'149.20	21.42	
XS1310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	0	300	0	300 EUR	84.16%	242'028.10	0.09	a)
XS2013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	0	250	0	250 EUR	62.93%	150'808.02	0.06	a)
XS2168038417	0.2500 % LITHUN 0 1/4 05/06/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.86%	269'941.70	0.10	a)
LT							662'777.82	0.25	
XS1409726731	1.3750 % LATVIA 1 3/8 05/16/36	0	500	0	500 EUR	74.43%	356'766.43	0.14	a)
XS2361416915	0.0000 % LATVIA 0 01/24/29 GMTN	0	500	0	500 EUR	81.17%	389'072.51	0.15	a)
LV							745'838.94	0.29	
NZGOVDT423C0	5.5000 % NZGB 5 1/2 04/15/23 0423	600	0	600	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	400	0	0	400 NZD	95.88%	201'700.93	0.08	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	530	0	0	530 NZD	98.35%	274'130.34	0.11	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	200	0	0	200 NZD	90.85%	95'556.44	0.04	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	0	280	0	280 NZD	77.90%	114'714.64	0.04	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	600	0	0	600 NZD	96.51%	304'558.35	0.12	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	0	260	0	260 NZD	94.54%	129'278.73	0.05	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	0	300	0	300 NZD	61.50%	97'040.62	0.04	a)
NZ							1'216'980.05	0.47	
PTOTE50E0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37	0	350	0	350 EUR	106.29%	356'614.01	0.14	a)
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45	0	320	0	320 EUR	106.95%	328'071.74	0.13	a)
PTOTECOEO0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	0	400	0	400 EUR	53.37%	204'649.88	0.08	a)
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	0	350	0	350 EUR	75.19%	252'283.12	0.10	a)
PTOTEZOEO0014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38	0	320	0	320 EUR	99.54%	305'352.80	0.12	a)
PT							1'446'971.55	0.55	
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	0	600	0	600 EUR	79.97%	459'979.07	0.18	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	0	600	0	600 EUR	74.89%	430'759.80	0.17	a)
SI							890'738.87	0.34	
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	0	1'000	0	1'000 EUR	64.91%	622'213.08	0.24	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	0	900	0	900 EUR	84.05%	725'117.99	0.28	a)
SK							1'347'331.07	0.52	
US912810EQ77	6.2500 % T 6 1/4 08/15/23	560	0	560	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	13'460	2'000	15'460	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	20'650	7'000	27'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	455	1'500	1'815	140 USD	109.31%	135'170.37	0.05	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	0	1'300	1'160	140 USD	102.38%	126'591.81	0.05	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	7'520	1'900	9'420	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	0	5'000	1'000	4'000 USD	78.36%	2'768'436.72	1.06	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	6'100	4'600	9'700	1'000 USD	78.17%	690'453.09	0.26	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	0	5'700	0	5'700 USD	68.86%	3'466'742.45	1.33	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	3'700	1'400	5'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	4'300	11'000	14'800	500 USD	64.02%	282'709.01	0.11	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	8'900	500	8'400 USD	52.27%	3'877'743.52	1.49	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	0	2'500	0	2'500 USD	61.88%	1'366'277.34	0.52	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	0	5'980	0	5'980 USD	63.81%	3'370'470.96	1.29	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	0	8'500	3'000	5'500 USD	67.17%	3'263'125.73	1.25	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	0	6'700	1'500	5'200 USD	61.44%	2'821'762.94	1.08	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	0	1'200	700	500 USD	90.09%	397'876.52	0.15	a)
US912828B667	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	17'000	2'100	19'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	4'800	0	4'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	8'000	8'000	9'000	7'000 USD	95.33%	5'893'899.65	2.26	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	0	6'100	0	6'100 USD	89.41%	4'817'052.29	1.85	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	0	19'500	0	19'500 USD	94.30%	16'241'777.14	6.23	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	11'800	9'800	11'700	9'900 USD	78.80%	6'890'136.65	2.64	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	0	25'000	13'200	11'800 USD	91.28%	9'513'651.36	3.65	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	5'350	10	5'340 USD	96.42%	4'547'790.77	1.74	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	0	23'100	0	23'100 USD	85.59%	17'462'163.12	6.69	a)
US							87'933'831.44	33.70	

Derivative Finanzinstrumente

-1'211'390.72 -0.46

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		10'000	9'852	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		6'728	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		14'132	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		12'659	13'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		9'493	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		5'532	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		7'131	7'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		6'843	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		44'341	63'360	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		44'636	70'185	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		407'207	59'650'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		9'987	16'950	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		646'621	682'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		459'268	469'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		147'509	1'099'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		93'284	82'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		12'000	11'408	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		8'000	7'864	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		1'500'000	10'271	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		6'530	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		10'000	9'264	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		9'000	8'890	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		700'000	4'828	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.01.2023		22'000	2'954	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		13'861	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		6'886	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		12'121	1'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		11'293	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		4'333	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		2'622	20'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		8'000	7'925	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		8'000	7'423	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		9'000	8'892	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		13'000	12'226	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		12'000	11'914	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		700'000	5'053	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		4'000	2'782	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		4'000	2'561	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		412'451	58'550'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		40'678	59'360	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		46'538	73'185	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		423'380	430'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		147'568	1'097'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		612'661	661'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		9'917	16'950	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		103'324	92'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		6'458	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		5'878	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		10'050	11'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'899	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		5'543	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		8'000	7'463	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		1'000'000	7'055	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		42'000	38'979	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		4'000	4'043	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		9'275	1'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		16'699	26'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		1'897	14'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		10'912	12'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		9'856	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		8'506	1'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		6'000	5'562	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		7'000	7'046	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		40'755	59'360	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		438'494	440'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		581'617	635'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		430'208	60'850'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		10'036	16'950	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		64'088	99'185	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		104'370	92'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		150'844	1'111'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		5'440	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		4'467	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		6'000	5'559	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		15'000	13'932		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		13'094	1'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		1'500	1'698		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		8'000	5'526		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		5'363	40'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		2'000	1'298		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		1'000	1'152		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		500'000	3'492		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		2'000	2'284		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		4'000	4'004		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		5'000	703		CNY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		104'074	92'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		578'976	620'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		428'735	62'250'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		61'275	97'185		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		35'239	51'360		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		9'807	16'950		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		154'249	1'146'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		432'639	436'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		5'000	5'035		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		10'000	9'414		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		7'406	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		5'472	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		4'877	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		10'886	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		4'859	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		728	1'140		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		1'804	3'015		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.04.2023		1'150	683		NZD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		6'775	1'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		1'000'000	6'993		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.04.2023		12'000	1'645		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		7'986	60'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		7'000	6'473		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		61'145	100'200		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		427'839	62'250'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2023		8'996	15'800		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		35'318	52'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		158'655	1'194'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		436'883	441'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		103'593	92'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		572'371	629'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		18'007	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		6'874	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		5'139	40'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		5'344	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		7'062	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		5'000	4'513		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		5'316	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		4'873	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		34'904	52'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		584'079	658'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		416'363	63'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		8'908	15'800		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		103'195	92'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		443'443	453'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		158'513	1'234'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		60'448	100'200		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		12'000	10'682		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		10'000	9'819		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		250'000	1'681		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		8'861	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		6'180	7'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		7'757	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		4'613	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		4'000	2'418		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		400'000	2'626		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		3'000	2'024		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		4'000	4'493		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		10'000	9'734		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		15'000	13'503		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		15'000	1'943		CNY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		99'375	88'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		56'754	96'200		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		428'915	441'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.07.2023		413'412	63'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.07.2023		156'216	1'219'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 07.07.2023		8'621	15'800	CHF/NZD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		589'960	648'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.07.2023		33'184	49'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.07.2023		1'000'000	6'337	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.07.2023		14'000	12'544	USD/CHF		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.07.2023		6'822	55'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 07.07.2023		15'000	14'729	EUR/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.07.2023		6'801	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		8'017	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.08.2023		33'417	49'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		575'725	643'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.08.2023		386'345	62'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.08.2023		100'224	88'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.08.2023		157'395	1'274'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.08.2023		8'756	15'800	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.08.2023		57'486	96'200	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		422'138	433'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		15'000	13'351	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.08.2023		12'000	11'712	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		4'298	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		12'463	13'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.08.2023		3'214	27'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		10'263	12'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		10'346	12'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.08.2023		7'000	6'744	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		15'000	13'011	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.08.2023		3'000	1'782	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 02.08.2023		18'000	2'198	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.08.2023		400'000	2'485	JPY/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023		32'491	49'500	CHF/CAD		196.43	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023		54'300	93'200	CHF/AUD		1'010.67	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023		367'888	60'200'000	CHF/JPY		2'539.57	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023		8'492	15'800	CHF/NZD		187.92	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		97'794	88'000	CHF/GBP		-627.95	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 07.09.2023		155'597	1'283'000	CHF/CNY		-43.11	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		539'739	625'000	CHF/USD		-11'889.75	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		397'720	417'000	CHF/EUR		-1'869.42	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		13'086	15'000	CHF/USD		-153.56	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		4'755	5'000	CHF/EUR		-36.34	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023		700'000	4'322	JPY/CHF		-73.25	0.00	b)
CHF/CNY	Verfall 07.09.2023		45'000	5'506	CNY/CHF		-47.12	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 07.09.2023		5'000	5'577	GBP/CHF		14.99	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		10'000	8'818	USD/CHF		8.04	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		6'980	8'000	CHF/USD		-81.31	0.00	b)
Klasse A hedged							-10'864.19	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.10.2022		35'969	53'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.10.2022		33'793	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.10.2022		112'664	798'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		485'971	499'500	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 11.10.2022		7'216	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.10.2022		307'641	43'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		336'931	343'500	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.10.2022		72'507	64'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		5'000	4'920	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.10.2022		400'000	2'844	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		4'000	4'561	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		3'000	2'976	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		3'855	4'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		3'361	3'500	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		3'808	4'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.10.2022		4'021	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		5'000	4'820	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		10'000	9'834	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		7'000	6'698	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		3'000	3'238	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.10.2022		350'000	2'423	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		3'000	3'227	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		5'000	4'932	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		6'000	5'700	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		2'000	2'138	GBP/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		4'438	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'465	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		32'904	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		6'756	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		59'554	54'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		319'225	329'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		34'191	53'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		292'184	42'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		6'000	5'970	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		479'665	484'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		111'054	798'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		5'000	4'992	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		7'000	6'786	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		4'000	4'413	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		4'955	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		7'000	7'049	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		3'000	1'901	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		8'000	1'143	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		300'000	2'074	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		9'907	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		6'000	6'030	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		5'632	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		6'000	6'003	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		700'000	4'747	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		5'892	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		32'493	50'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		63'216	55'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		33'278	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		107'683	790'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		474'306	475'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		7'015	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		318'126	322'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		281'114	41'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		4'683	700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		3'913	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		6'000	6'094	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		5'000	4'970	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		4'906	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		3'925	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		6'000	5'923	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		500'000	3'394	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		4'797	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		9'412	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		4'850	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		5'412	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		4'420	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		5'865	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		4'754	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		106'035	790'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		463'159	488'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		66'712	59'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		329'028	336'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		32'371	50'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		7'129	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		31'842	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		291'837	42'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		10'000	9'512	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'885	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		1'000'000	6'858	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		5'593	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		7'435	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		4'901	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		9'000	8'341	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'921	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		500'000	3'457	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.01.2023		10'000	1'359	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		9'231	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		4'910	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		12'121	1'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		9'028	8'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		3'086	5'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		2'224	17'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'938	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		8'000	7'450	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		7'000	6'929		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		6'000	5'659		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		6'000	5'972		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		700'000	5'053		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		2'000	1'406		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		3'000	1'928		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		444'434	479'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		298'331	42'350'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		107'212	797'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		307'197	312'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		7'079	12'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		74'840	67'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		33'639	52'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		29'810	43'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		5'531	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'893	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		7'301	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		3'913	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		4'846	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		8'000	7'463		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		5'000	5'036		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		800'000	5'650		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		29'000	26'923		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		8'559	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		11'552	18'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		1'209	9'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		7'265	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		6'890	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		4'950	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		5'000	4'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		4'000	4'039		EUR/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		7'165	12'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		312'140	44'150'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		317'908	319'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		420'871	459'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		109'433	806'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		75'597	67'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		29'866	43'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		45'812	70'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		4'528	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		3'343	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		5'000	4'637		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		10'000	9'298		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		8'950	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		1'500	1'698		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		6'000	4'152		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		4'015	30'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		300'000	2'107		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		3'000	3'010		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		2'000	2'284		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		6'000	838		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		313'564	316'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		310'962	45'150'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		419'757	449'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		44'702	70'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		111'716	830'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		25'729	37'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		7'001	12'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		75'228	66'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		4'000	4'034		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		6'000	5'661		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		3'688	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		4'555	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		3'896	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		9'067	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		5'836	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		5'414	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		600'000	4'208		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		5'314	40'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		5'000	4'632		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		416'311	457'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		115'603	870'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		74'880	66'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		43'266	70'900		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		311'687	45'350'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2023		6'889	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		318'994	322'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		25'227	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		10'000	9'130	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		12'000	11'918	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2023		1'100'000	7'591	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		13'498	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		7'856	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		5'289	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		4'000	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		5'000	4'513	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		4'425	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		4'873	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		42'772	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		24'931	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		111'756	870'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		316'186	323'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		415'868	468'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		74'592	66'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		296'176	44'850'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		6'822	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		9'000	8'019	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		7'000	6'883	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		6'194	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		5'293	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		4'837	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		3'287	500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		2'000	2'261	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		25'139	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		41'828	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		312'204	321'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		72'837	64'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.07.2023		6'602	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		430'179	472'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		297'120	45'350'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		111'491	870'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		4'384	700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.07.2023		6'000	5'909	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		9'314	75'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		3'099	3'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		4'849	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		311'973	320'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.08.2023		42'368	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		286'492	46'050'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		426'198	476'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.08.2023		116'749	945'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		25'316	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.08.2023		6'705	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		73'460	64'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		12'000	10'687	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.08.2023		8'000	7'818	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		4'298	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		7'690	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.08.2023		2'253	19'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		8'619	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		8'617	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		41'307	70'900	CHF/AUD		768.84	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 07.09.2023		116'910	964'000	CHF/CNY		-32.40	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		6'503	12'100	CHF/NZD		143.91	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		414'520	480'000	CHF/USD		-9'131.33	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		71'678	64'500	CHF/GBP		-460.24	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		24'615	37'500	CHF/CAD		148.81	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		306'158	321'000	CHF/EUR		-1'439.05	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		281'416	46'050'000	CHF/JPY		1'942.65	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		500'000	3'095	JPY/CHF		-60.87	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 07.09.2023		15'000	1'855	CNY/CHF		-35.65	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		8'714	10'000	CHF/USD		-112.37	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		8'000	7'060	USD/CHF		0.44	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		6'980	8'000	CHF/USD		-81.31	0.00	b)
	Klasse B hedged						-8'348.57	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		1'404'616	1'432'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		306'454	270'500	CHF/GBP		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		2'034'365	2'091'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		1'281'957	182'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.10.2022		30'115	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.10.2022		140'462	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.10.2022		147'415	220'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		469'433	3'325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		9'000	10'226	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		20'000	19'591	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'657	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		5'000	5'694	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		25'000	24'582	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		24'249	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.10.2022		19'345	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.10.2022		13'474	2'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		14'361	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'400	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		50'000	49'052	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		35'000	33'369	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		15'000	16'070	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		800'000	5'501	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		12'000	12'817	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'737	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.10.2022		16'000	15'150	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.10.2022		11'000	11'622	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		2'000'000	13'746	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.10.2022		16'726	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.10.2022		15'000	14'743	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.10.2022		1'200'000	8'182	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		140'128	220'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		1'225'464	179'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		462'724	3'325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		1'339'970	1'381'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		1'990'930	2'011'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		248'693	225'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2022		28'195	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		10'000	9'733	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		136'768	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		30'000	29'954	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		25'000	24'237	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		6'000	6'620	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		9'940	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		5'000	3'157	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		20'000	20'084	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		2'000'000	13'658	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		22'000	3'090	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		39'720	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		20'000	20'031	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		25'000	24'916	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		2'000'000	13'506	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		13'662	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		24'647	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		266'080	231'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		29'278	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		450'225	3'303'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		1'180'344	175'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		137'823	215'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		138'322	189'125	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		1'985'999	1'991'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		1'329'805	1'346'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		13'437	2'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'755	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		15'000	14'849	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		30'000	30'348	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		24'648	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		30'000	29'496	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		3'000'000	20'214	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		17'349	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'733	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		42'457	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		24'372	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		27'180	4'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		16'656	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		19'016	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		14'663	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		137'307	215'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		132'353	189'125		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		1'933'227	2'039'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		278'722	246'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		1'217'183	178'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		29'754	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		443'332	3'303'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		1'371'929	1'401'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		20'000	19'616		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		3'000'000	20'513		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		30'000	28'476		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'713	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		18'632	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		30'000	27'733		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		12'000	11'844		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		1'500'000	10'311		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.01.2023		40'000	5'347		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		46'274	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		19'731	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		45'262	40'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		47'222	7'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		11'811	19'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		8'855	67'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		20'000	19'767		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		30'000	27'754		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		25'000	24'646		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		40'000	37'556		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		5'000'000	35'909		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2023		8'000	5'534		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		45'000	44'597		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		11'000	6'989		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		1'238'409	175'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		1'279'002	1'299'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'852'813	1'999'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		124'122	181'125		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		447'952	3'330'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		142'378	223'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		320'025	286'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		29'546	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		23'142	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		22'616	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		32'042	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		14'758	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		27'833	4'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		2'500'000	17'593		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		25'000	23'257		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		125'000	115'949		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		15'000	15'079		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		25'022	3'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		49'514	77'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		5'339	39'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		29'627	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		31'884	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		24'868	3'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		15'000	13'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		12'000	12'058		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		194'427	300'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		124'355	181'125		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		1'302'997	184'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'335'415	1'340'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		1'766'833	1'929'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		29'902	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		457'419	3'369'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		323'264	286'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		13'644	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		7'840	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		20'000	18'458		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		10'000	9'906		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		40'000	37'103		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		41'415	6'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		5'000	5'591		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		17'497	130'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		25'000	17'204		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		5'000	3'200		AUD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		1'200'000	8'338		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		4'000	4'519		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		5'000	5'664		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		20'000	2'722		CNY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		316'182	279'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		1'319'747	1'330'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'759'339	1'884'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		468'266	3'479'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		29'219	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		107'119	156'125		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		186'563	295'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'302'390	189'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		15'000	14'915		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		15'000	14'072		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		10'000	10'039		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		1'000'000	6'938		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.04.2023		25'000	3'442		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		22'896	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		19'599	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		36'356	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		16'592	17'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		2'811	4'275		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		27'192	4'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		1'500'000	10'475		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		1'500'000	10'522		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		26'689	200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		15'000	13'836		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		180'568	295'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		107'905	160'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		1'299'669	189'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		1'746'232	1'919'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		485'533	3'654'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		1'329'471	1'342'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		314'721	279'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2023		28'752	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		58'592	65'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		21'656	22'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		15'477	120'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		20'121	3'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		22'132	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		20'000	17'960		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		17'790	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		19'584	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		28'472	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		1'354'802	1'384'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		484'789	3'774'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		1'783'305	2'009'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		1'268'571	192'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		313'512	279'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		106'640	160'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		178'508	295'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		35'000	31'099		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		30'000	29'398		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		22'199	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		22'148	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		13'237	2'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		24'305	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		1'271'685	194'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		1'341'211	1'379'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		174'570	295'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		315'627	279'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		1'842'714	2'024'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		483'642	3'774'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		107'530	160'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.07.2023		27'553	50'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.07.2023		30'000	29'427		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		18'889	3'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		33'608	270'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		20'462	21'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		14'276	16'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		1'335'634	1'370'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.08.2023		499'612	4'044'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		1'826'563	2'040'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		1'226'224	197'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NZD/CHF	Verfall 02.08.2023		27'985	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.08.2023		108'285	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.08.2023		318'325	279'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.08.2023		176'821	295'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.08.2023		50'000	44'434	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.08.2023		35'000	34'103	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.08.2023		15'000	17'115	GBP/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		17'284	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		34'280	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.08.2023		10'784	90'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.08.2023		38'410	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		34'556	40'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.09.2023		501'355	4'134'000	CHF/CNY		-138.91	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023		105'285	160'400	CHF/CAD		636.50	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		293'936	264'500	CHF/GBP		-1'887.39	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023		1'204'498	197'100'000	CHF/JPY		8'314.77	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		1'787'617	2'070'000	CHF/USD		-39'378.87	-0.02	b)
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		1'311'426	1'375'000	CHF/EUR		-6'164.16	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023		27'142	50'500	CHF/NZD		600.64	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023		172'395	295'900	CHF/AUD		3'208.76	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023		1'400'000	8'613	JPY/CHF		-116.56	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		26'201	30'000	CHF/USD		-277.13	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		11'064	10'000	CHF/GBP		-120.23	0.00	b)
CHF/CNY	Verfall 07.09.2023		50'000	6'114	CNY/CHF		-48.86	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		25'000	22'000	USD/CHF		65.08	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		21'875	25'000	CHF/USD		-190.37	0.00	b)
Klasse It hedged							-35'496.73	-0.01	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		44'629'904	45'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.10.2022		40'859'289	5'804'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.10.2022		14'993'635	106'200'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.10.2022		4'545'293	6'120'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.10.2022		9'867'698	8'710'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		64'737'764	66'540'000	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 11.10.2022		954'392	1'600'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.10.2022		4'766'788	7'143'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		360'000	407'939	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		350'000	342'395	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.10.2022		20'000'000	140'714	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		130'000	147'294	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		400'000	392'912	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		485'491	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.10.2022		435'860	450'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.10.2022		479'619	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.10.2022		405'024	60'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		600'000	578'044	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		1'300'000	1'274'828	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		900'000	857'446	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		600'000	641'738	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		250'000	266'454	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		400'000	392'279	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.10.2022		450'000	425'343	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.10.2022		300'000	316'219	GBP/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.10.2022		446'730	400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.10.2022		70'000'000	480'151	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.10.2022		500'000	490'528	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.10.2022		40'000'000	271'782	JPY/CHF		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.11.2022		893'521	1'600'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.11.2022		4'531'162	7'143'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.11.2022		14'779'323	106'200'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.11.2022		4'425'739	6'120'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2022		42'935'333	44'250'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2022		63'697'887	64'340'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2022		7'962'577	7'220'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.11.2022		300'000	291'152	EUR/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2022		39'190'227	5'734'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2022		1'000'000	998'454	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.11.2022		900'000	872'529	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.11.2022		200'000	220'668	GBP/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2022		398'700	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.11.2022		180'000	112'603	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2022		500'000	501'461	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.11.2022		60'000'000	408'919	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.11.2022		160'000	115'619	CAD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		110'000	68'633	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		550'000	76'534	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2022		60'000	33'541	NZD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		1'192'250	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		1'000'000	1'000'256	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		600'000	597'390	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		60'000'000	404'364	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		456'321	400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		789'505	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		37'800'634	5'614'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		8'528'363	7'420'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		42'532'022	43'050'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		14'400'940	105'650'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		4'374'729	6'853'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		4'359'025	5'960'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		63'480'136	63'640'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		893'064	1'540'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		471'239	70'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		493'884	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		800'000	808'632	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		400'000	395'250	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		50'000'000	337'917	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		392'796	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		345'121	350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		723'968	750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		688'814	700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		1'415'963	1'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		634'325	650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		1'020'150	150'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		556'105	500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		472'327	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		4'358'337	6'853'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2023		4'170'927	5'960'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.01.2023		907'596	1'540'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		14'180'449	105'650'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		62'566'769	65'990'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		43'919'363	44'850'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		39'485'054	5'784'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		8'955'302	7'920'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		900'000	853'551	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		120'000'000	819'468	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		374'784	400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		559'740	600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		225'852	1'700'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2023		1'388'832	1'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2023		592'698	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.01.2023		1'687'238	250'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2023		1'698'105	1'500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2023		498'482	800'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.01.2023		198'885	1'500'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		700'000	690'927	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		400'000	393'931	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2023		1'500'000	1'407'515	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2023		1'300'000	1'287'738	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.01.2023		70'000'000	502'416	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2023		260'000	164'529	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		61'256'838	66'090'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		42'387'245	43'050'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		4'084'281	5'960'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		4'701'223	7'393'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		10'522'291	9'420'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		14'642'502	108'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		901'240	1'540'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		41'167'590	5'844'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		648'676	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		590'643	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		916'168	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		394'254	400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		626'790	90'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		600'000	557'553	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		90'000'000	632'394	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		4'400'000	4'081'185	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		1'001'868	140'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		1'608'263	2'500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		284'898	2'070'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'093'980	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		741'270	750'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		711'234	100'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		500'000	461'106	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		700'000	701'758	EUR/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		6'392'362	9'893'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		43'013'758	6'084'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		4'091'957	5'960'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		912'086	1'540'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		58'152'523	63'490'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		43'949'090	44'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		10'628'774	9'420'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		15'059'941	110'920'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		820'290	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		337'208	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		500'000	460'799	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		4'000'000	3'708'060	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		1'700'000	1'681'390	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		11'000'000	76'014	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		530'000	589'601	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		960'000	659'606	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		220'000	139'822	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		20'000'000	138'197	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		230'000	145'837	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		100'998	750'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		180'000	202'882	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		15'030'559	111'670'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		55'927'198	59'890'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		42'073'138	42'400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		3'430'555	5'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		10'192'481	9'010'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		41'688'887	6'053'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		891'252	1'540'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		5'953'764	9'443'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		400'000	397'004	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.04.2023		1'000'000	136'510	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'100'210	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		686'883	700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'182'325	1'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		586'523	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		5'418	9'600	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'020'600	150'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		60'000'000	417'864	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		50'000'000	349'805	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		1'001'730	7'500'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		400'000	368'220	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		56'409'040	61'990'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2023		5'762'440	9'443'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		15'702'075	118'170'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		42'895'751	43'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2023		882'477	1'550'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2023		10'145'395	9'010'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2023		3'363'630	5'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		41'876'702	6'093'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		443'480	450'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		1'623'042	1'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2023		671'570	100'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		886'297	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2023		503'864	3'900'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		600'000	538'020	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		445'406	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		882'446	900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		5'696'698	9'443'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		57'422'596	64'690'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		873'896	1'550'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		15'680'502	122'070'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		10'106'409	9'010'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		3'324'185	5'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		40'896'714	6'193'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		43'708'019	44'650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		800'000	710'299	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		750'000	734'351	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		711'174	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		620'858	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		583'923	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		596'900	90'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		41'164'331	6'283'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		43'280'567	44'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		15'643'393	122'070'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		59'533'148	65'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		10'174'606	9'010'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		5'571'021	9'443'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		3'351'925	5'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.07.2023		845'686	1'550'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		630'500	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		1'120'977	9'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.07.2023		600'000	588'064		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		455'904	510'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		390'250	400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.07.2023		782'116	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.07.2023		869'253	140'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.07.2023		65'386	120'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.07.2023		370'542	3'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		806'882	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.07.2023		214'833	190'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.07.2023		162'234	240'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.07.2023		294'164	497'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.08.2023		16'563'544	134'070'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2023		10'477'972	9'200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		59'810'983	66'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2023		40'581'736	6'523'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.08.2023		5'939'846	9'940'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.08.2023		925'447	1'670'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		43'968'667	45'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2023		3'537'487	5'240'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		1'500'000	1'332'402		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.08.2023		1'200'000	1'168'440		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.08.2023		500'000	569'623		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		432'757	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.08.2023		180'204	1'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2023		1'152'985	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		1'200'629	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		1'123'829	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		3'439'484	5'240'000		CHF/CAD	20'793.21	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		58'507'748	67'750'000		CHF/USD	-1'288'849.47	-0.49	b)
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		9'668'223	8'700'000		CHF/GBP	-62'080.52	-0.02	b)
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		39'862'705	6'523'000'000		CHF/JPY	275'176.10	0.11	b)
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		43'014'756	45'100'000		CHF/EUR	-202'184.30	-0.08	b)
	CNY/CHF Verfall 07.09.2023		16'441'387	135'570'000		CHF/CNY	-4'555.24	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		897'577	1'670'000		CHF/NZD	19'862.52	0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		5'791'183	9'940'000		CHF/AUD	107'790.01	0.04	b)
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		100'000'000	613'198		JPY/CHF	-6'305.93	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		332'754	300'000		CHF/GBP	-2'773.22	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		1'136'450	1'300'000		CHF/USD	-10'943.12	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 07.09.2023		1'500'000	182'561		CNY/CHF	-595.90	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		900'000	791'089		USD/CHF	3'260.90	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		700'812	800'000		CHF/USD	-5'276.27	0.00	b)
	Klasse Nt hedged						-1'156'681.23	-0.44	
	Devisentermingeschäfte auf Klassen						-1'211'390.72	-0.46	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'012'493.34	0.77
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	258'556'158.21	99.10
Derivative Finanzinstrumente	-1'211'390.72	-0.46
Sonstige Vermögenswerte	1'549'941.87	0.59
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	260'907'202.70	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-10'241.41	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	260'896'961.29	

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);	258'556'158.21	99.10
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'211'390.72	-0.46
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57203686
CAD	1 = CHF	0.65283270
CNY	1 = CHF	0.12135055
EUR	1 = CHF	0.95863723
GBP	1 = CHF	1.11921024
JPY	100 = CHF	0.60669000
NZD	1 = CHF	0.52593121
USD	1 = CHF	0.88325000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'656'339.13	0.635
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	189'491'541.28	72.631

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2022 - 31.08.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
A	CHF	0.10	-	0.10	-
A hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
B	CHF	0.10	-	0.10	-
B hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
It	CHF	0.10	-	0.10	-
It hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
Nt	CHF	0.10	-	0.10	-
Nt hedged	CHF	0.10	-	0.10	-

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.09.2022 - 31.08.2023

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

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

8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Treasuries Total Return Index Value unhedged CHF

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 05.12.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 08.12.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Ja	CHF	1.10000	0.38500	0.71500
A hedged	Ja	CHF	1.15000	0.40250	0.74750

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 05.12.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 08.12.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Ja	CHF	1.223	0.428	0.795
B hedged	Ja	CHF	1.207	0.422	0.785
It	Ja	CHF	1.650	0.577	1.073
It hedged	Ja	CHF	1.725	0.603	1.122
Nt	Ja	CHF	1.959	0.685	1.274
Nt hedged	Ja	CHF	1.959	0.685	1.274

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

bestimmt.

Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

BEKB Obligationenfonds

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

mit den Teilvermögen

BEKB Obligationen CHF

BEKB Obligationen Global Staatsanleihen

BEKB Obligationen Global Unternehmensanleihen

BEKB Obligationen Nachhaltig CHF

BEKB Obligationen Nachhaltig Global

BEKB Obligationen CHF Short Duration

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 7. Juni 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich