

# BEKB OBLIGATIONEN NACHHALTIG GLOBAL

Jahresbericht per 31.08.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
A	36598207	CHF
B	36598206	CHF
It	36598204	CHF
Nt	36598209	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 20.12.2024

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

BEKB Obligationenfonds,

mit den Teilvermögen

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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

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



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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



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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. August 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	19
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	19
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	19
7	Verwaltungskommission	20
8	Benchmark	20
9	TER	20
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	21
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	21
12	Fussnoten	21
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	22

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.09.2023	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020
	bis	31.08.2024	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		224'777'304.63	185'382'956.90	230'434'901.81	215'580'792.48
<b>Klasse A</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		928'788.34	880'789.48	979'947.13	1'174'486.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'117.467	11'455.467	11'992.467	12'038.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		76.65	76.89	81.71	97.56
Ausschüttung je Anteil		1.30	1.45	1.40	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
<b>Klasse B</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'964'009.53	1'793'742.69	1'541'930.81	1'523'280.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'962.001	22'092.001	18'075.001	15'125.001
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		81.96	81.19	85.31	100.71
Thesaurierung je Anteil		1.42	1.50	1.46	1.53
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
<b>Klasse It</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'361'497.89	5'395'647.89	5'604'880.37	6'664'475.27
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		85'827.807	63'737.807	63'237.807	63'926.653
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		85.77	84.65	88.63	104.25
Thesaurierung je Anteil		1.96	2.05	2.07	2.18
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
<b>Klasse Nt</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		214'523'008.87	177'312'776.84	222'308'143.50	206'218'550.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'522'491.308	2'116'555.167	2'539'236.786	2'006'443.611
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		85.04	83.77	87.55	102.78
Thesaurierung je Anteil		2.19	2.28	2.33	2.45
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

### Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	1.60 %	1.88 %	-16.69 %	-3.62 %
Klasse B	1.61 %	1.89 %	-16.70 %	-3.62 %
Klasse It	2.19 %	2.47 %	-16.23 %	-3.07 %
Klasse Nt	2.49 %	2.77 %	-15.97 %	-2.78 %
Benchmark	2.83 %	2.79 %	-13.65 %	-2.54 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	0.81 %	0.98 %	1.32 %	0.43 %

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	-1.23 %
Klasse B	-1.22 %
Klasse It	-0.64 %
Klasse Nt	-0.34 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	2'160'088.05	4'110'774.24
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	219'038'862.42	180'857'892.64
Derivative Finanzinstrumente	1'818'924.18	-1'177'373.93
Sonstige Vermögenswerte	1'768'605.89	1'599'666.23
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>224'786'480.54</b>	<b>185'390'959.18</b>
Andere Verbindlichkeiten	-9'175.91	-8'002.28
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>224'777'304.63</b>	<b>185'382'956.90</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'455.467	11'992.467
Ausgegebene Anteile		2'724.000	863.000
Zurückgenommene Anteile		-2'062.000	-1'400.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>12'117.467</b>	<b>11'455.467</b>
<b>Klasse B</b>			
	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'092.001	18'075.001
Ausgegebene Anteile		3'770.000	4'917.000
Zurückgenommene Anteile		-1'900.000	-900.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>23'962.001</b>	<b>22'092.001</b>
<b>Klasse It</b>			
	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		63'737.807	63'237.807
Ausgegebene Anteile		22'090.000	3'100.000
Zurückgenommene Anteile		-	-2'600.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>85'827.807</b>	<b>63'737.807</b>
<b>Klasse Nt</b>			
	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'116'555.167	2'539'236.786
Ausgegebene Anteile		531'360.575	490'351.811
Zurückgenommene Anteile		-125'424.434	-913'033.430
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'522'491.308</b>	<b>2'116'555.167</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		185'382'956.90	230'434'901.81
Ausbezahlte Ausschüttung		-18'153.23	-15'648.45
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'787'998.75	-1'890'646.50
Saldo aus dem Anteilverkehr		35'490'157.35	-35'626'770.82
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		5'710'342.36	-7'518'879.14
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>224'777'304.63</b>	<b>185'382'956.90</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		34'667.03	18'018.59
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-3'665.99	-2'064.56
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		5'298'213.28	5'062'718.57
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		672'598.21	522'809.85
<b>Total Ertrag</b>		<b>6'001'812.53</b>	<b>5'601'482.45</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-986.56	-216.74
Reglementarische Vergütungen		-100'696.03	-93'612.73
Sonstige Aufwendungen		0.00	-10.40
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-131'215.44	-493'151.40
<b>Total Aufwand</b>		<b>-232'898.03</b>	<b>-586'991.27</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>5'768'914.50</b>	<b>5'014'491.18</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-19'137'793.03	-15'773'290.09
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		86'194.20	177'927.48
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-13'282'684.33</b>	<b>-10'580'871.43</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		18'993'026.69	3'061'992.29
<b>Gesamterfolg</b>		<b>5'710'342.36</b>	<b>-7'518'879.14</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse A</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	16'234.02	16'363.87
Vortrag des Vorjahres	22.87	269.43
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>16'256.89</b>	<b>16'633.30</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	15'752.71	16'610.43
Vortrag auf neue Rechnung	504.18	22.87
<b>Total</b>	<b>16'256.89</b>	<b>16'633.30</b>
<b>Klasse B</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	34'195.53	33'247.72
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>34'195.53</b>	<b>33'247.72</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	11'968.44	11'636.70
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	22'227.09	21'611.02
<b>Total</b>	<b>34'195.53</b>	<b>33'247.72</b>
<b>Klasse It</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	169'014.49	130'898.58
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>169'014.49</b>	<b>130'898.58</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	59'155.07	45'814.50
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	109'859.42	85'084.08
<b>Total</b>	<b>169'014.49</b>	<b>130'898.58</b>
<b>Klasse Nt</b>	<b>31.08.2024</b>	<b>31.08.2023</b>
Nettoertrag	5'549'470.46	4'833'981.01
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>5'549'470.46</b>	<b>4'833'981.01</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'942'314.66	1'691'893.35
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'607'155.80	3'142'087.66
<b>Total</b>	<b>5'549'470.46</b>	<b>4'833'981.01</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>219'038'862.42</b>	<b>97.44</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>219'038'862.42</b>	<b>97.44</b>	
XS2106056653	0.2500 % RBAIV 0 1/4 01/22/25 EMTN	0	500	0	500 EUR	98.59%	462'936.91	0.21	a)
XS2821745374	3.2500 % VERA V 3 1/4 05/17/31	0	500	0	500 EUR	101.41%	476'202.45	0.21	a)
<b>AT</b>							<b>939'139.36</b>	<b>0.42</b>	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	1'400	0	1'400	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000078552	1.5000 % TC V 1 1/2 11/20/30	2'000	0	1'000	1'000 AUD	84.94%	488'982.68	0.22	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'800	0	1'800	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	2'500	2'000	2'500	2'000 AUD	82.33%	947'857.65	0.42	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	0	500	0	500 AUD	88.99%	256'151.60	0.11	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	3'000	0	3'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	2'000	0	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	1'000	0	500	500 AUD	96.46%	277'644.37	0.12	a)
AU3CB0268126	2.2000 % CGJAU 2.2 11/06/26 MTN	500	0	0	500 AUD	95.13%	273'813.26	0.12	a)
AU3CB0271989	2.2500 % QTC 2 1/4 11/20/41	1'000	0	500	500 AUD	66.84%	192'401.54	0.09	a)
AU3CB0289817	3.9000 % NAB 3.9 05/30/25 MTN	475	1'000	0	1'475 AUD	99.52%	845'008.43	0.38	a)
AU3CB0293769	6.8600 % CBAAU 6.86 11/09/32 MTN	500	0	0	500 AUD	105.28%	303'045.95	0.13	a)
AU3CB0294502	4.9500 % NAB 4.95 11/25/27 MTN	500	0	0	500 AUD	101.73%	292'822.00	0.13	a)
AU3SG0000417	5.0000 % NSWTC 5 08/20/24 24	700	0	700	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0001647	4.2000 % QTC 4.2 02/20/47 47	1'000	0	0	1'000 AUD	86.77%	499'482.96	0.22	a)
AU3SG0001860	3.2500 % QTC 3 1/4 08/21/29	1'000	0	0	1'000 AUD	96.57%	555'904.71	0.25	a)
AU3SG0002223	2.2500 % TC V 2 1/4 11/20/42 MTN	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002256	2.0000 % TC V 2 11/20/37 MTN	1'500	1'000	1'200	1'300 AUD	69.95%	523'466.09	0.23	a)
AU3SG0002264	2.4000 % TC V 2.4 08/18/50 MTN	500	0	0	500 AUD	56.91%	163'802.09	0.07	a)
AU3SG0002421	0.5000 % TC V 0 1/2 11/20/25 MTN	500	500	0	1'000 AUD	95.90%	552'041.94	0.25	a)
AU3SG0002504	2.2500 % TC V 2 1/4 09/15/33	1'000	0	500	500 AUD	81.85%	235'579.92	0.10	a)
AU3SG0002710	4.7500 % TC V 4 3/4 09/15/36 MTN	600	500	0	1'100 AUD	97.84%	619'581.66	0.28	a)
AU3SG0002793	4.2500 % WATC 4 1/4 07/20/33	500	0	0	500 AUD	98.48%	283'467.30	0.13	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	2'600	0	2'600	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	1'900	0	1'900	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	2'600	500	2'600	500 AUD	99.41%	286'129.79	0.13	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	4'000	0	4'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
US00205GAB32	4.2000 % APAAU 4.2 03/23/25 144A	0	500	0	500 USD	99.42%	421'768.74	0.19	a)
US00205GAC15	5.0000 % APAAU 5 03/23/35 144A	0	300	0	300 USD	96.43%	245'440.46	0.11	a)
US556079AC52	3.6240 % MQGAU 3.624 06/03/30 144A	500	0	0	500 USD	92.25%	391'360.29	0.17	a)
US80622GAE44	4.3750 % SCGAU 4 3/8 05/28/30 144A	500	0	0	500 USD	98.27%	416'902.88	0.19	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	800	0	0	800 USD	99.14%	672'895.51	0.30	a)
XS2315784715	0.7500 % APAAU 0 3/4 03/15/29 EMTN	650	0	0	650 EUR	88.65%	541'151.48	0.24	a)
XS2887839855	4.6250 % TOYOTA 4 5/8 03/29/28 EMTN	0	400	0	400 GBP	99.64%	444'406.61	0.20	a)
<b>AU</b>							<b>10'731'109.91</b>	<b>4.77</b>	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002830116	0.7500 % PROXBB 0 3/4 11/17/36 EMTN	500	0	200	300 EUR	71.86%	202'471.15	0.09	a)
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	200	0	100	100 EUR	87.75%	82'412.59	0.04	a)
BE6355215664	3.5000 % LONNVX 3 1/2 09/04/34	0	100	0	100 EUR	98.63%	92'626.83	0.04	a)
<b>BE</b>							<b>377'510.57</b>	<b>0.17</b>	
CA013051DY00	3.0500 % ALTA 3.05 12/01/48	0	350	0	350 CAD	82.03%	180'745.82	0.08	a)
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	400	0	0	400 CAD	76.41%	192'412.28	0.09	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	2'000	2'200	4'200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	50	4'000	2'700	1'350 CAD	98.85%	840'126.98	0.37	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	200	150	300	50 CAD	77.68%	24'451.60	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	50	150	200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	0	1'180	0	1'180 CAD	89.92%	667'989.61	0.30	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	800	0	800	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	350	0	350	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	300	0	300	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA44810ZAS98	4.8900 % HYDONE 4.89 03/13/37 MTN	500	0	0	500 CAD	102.72%	323'320.67	0.14	a)
CA448814JC89	2.1000 % QHEL 2.1 02/15/60 JR	250	0	0	250 CAD	62.10%	97'736.22	0.04	a)
CA47788ZAM38	2.8100 % DE 2.81 01/19/29	400	0	0	400 CAD	95.65%	240'860.96	0.11	a)
CA563469TM71	4.1000 % MP 4.1 03/05/41	800	0	200	600 CAD	97.70%	369'034.67	0.16	a)
CA563469UX18	2.0500 % MP 2.05 06/02/31	100	0	0	100 CAD	91.16%	57'385.50	0.03	a)
CA628153AB44	3.8300 % CANMFA 3.83 06/01/37 B	0	1'200	1'200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA628153AC27	3.8600 % CANMFA 3.86 12/01/48 C	0	800	800	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA628153DS42	3.3820 % CANMFA 3.382 06/01/57	0	300	300	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA66989ZEG96	3.5000 % NS 3 1/2 06/02/62 MTN	0	300	0	300 CAD	85.72%	161'882.56	0.07	a)
CA683234YD42	4.7000 % ONT 4.7 06/02/37	0	300	200	100 CAD	106.83%	67'251.51	0.03	a)
CA68323ACC68	3.4500 % ONT 3.45 06/02/45	400	0	300	100 CAD	89.57%	56'384.55	0.03	a)
CA68323ADZ45	2.8000 % ONT 2.8 06/02/48	0	350	0	350 CAD	78.93%	173'904.39	0.08	a)
CA748148RL96	5.7500 % Q 5 3/4 12/01/36	0	600	0	600 CAD	116.63%	440'529.22	0.20	a)
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	300	0	0	300 CAD	88.84%	167'782.52	0.07	a)
CA74814ZFY15	4.4000 % Q 4.4 12/01/55	0	350	0	350 CAD	103.56%	228'181.90	0.10	a)
CA803854KJ60	2.2000 % SCDA 2.2 06/02/30	100	0	0	100 CAD	93.78%	59'038.65	0.03	a)
CA891145T792	3.2260 % TD 3.226 07/24/24 DPNT	300	0	300	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	0	140	140	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2027438899	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN	1'000	0	300	700 EUR	59.59%	391'722.78	0.17	a)
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>CA</b>							<b>4'740'742.39</b>	<b>2.11</b>	
CH0520042489	0.2500 % UBS 0 1/4 01/29/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	98.59%	1'111'138.73	0.49	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>CH</b>							<b>1'111'138.73</b>	<b>0.49</b>	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	0	450	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	0	355	355	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	0	510	510	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	0	1'010	1'010	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	5'920	5'920	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	200	325	525	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.77%	449'690.15	0.20	a)
DE000BHY0BP6	1.0000 % BHH 1 02/05/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	96.45%	362'314.13	0.16	a)
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JD71	1.7500 % KFW 1 3/4 09/14/29	500	0	0	500 USD	90.63%	384'466.63	0.17	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	0	200	0	200 USD	100.13%	169'913.99	0.08	a)
XS0460071078	5.5200 % DB 5.52 09/01/28 EMTN	0	200	0	200 USD	100.95%	171'300.36	0.08	a)
XS2152899584	1.0000 % EOANGR 1 10/07/25 EMTN	0	400	0	400 EUR	97.67%	366'889.68	0.16	a)
XS2892988275	3.6250 % LHAGR 3 5/8 09/03/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.71%	187'291.61	0.08	a)
<b>DE</b>							<b>2'091'866.55</b>	<b>0.93</b>	
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	500	0	0	500 GBP	93.63%	522'016.98	0.23	a)
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	2'000	190	1'400	790 GBP	104.70%	922'329.94	0.41	a)
<b>DK</b>							<b>1'444'346.92</b>	<b>0.64</b>	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	4'000	20	3'770	250 EUR	101.44%	238'174.01	0.11	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	0	1'290	0	1'290 EUR	109.92%	1'331'689.53	0.59	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	0	2'800	1'470	1'330 EUR	99.89%	1'247'675.11	0.56	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	0	45	0	45 EUR	95.96%	40'554.95	0.02	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	700	175	540	335 EUR	89.30%	280'955.59	0.12	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	800	440	660	580 EUR	92.70%	504'967.03	0.22	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	0	660	0	660 EUR	97.37%	603'533.25	0.27	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	0	500	0	500 EUR	88.24%	414'340.41	0.18	a)
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	0	230	0	230 EUR	90.19%	194'804.37	0.09	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	500	0	450	50 EUR	88.67%	41'638.31	0.02	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	0	255	0	255 EUR	91.66%	219'499.18	0.10	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	600	720	720	600 EUR	71.97%	405'562.14	0.18	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	670	920	130	1'460 EUR	50.29%	689'489.83	0.31	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	0	510	0	510 EUR	74.30%	355'863.83	0.16	a)
ES0000012I15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	0	1'920	630	1'290 EUR	94.02%	1'139'096.11	0.51	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	0	780	220	560 EUR	85.41%	449'198.59	0.20	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	900	700	780	820 EUR	68.79%	529'763.50	0.24	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	1'000	10	860	150 EUR	97.47%	137'307.52	0.06	a)
XS2645245122	0.9130 % SANSCEF 0.913 07/07/26 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	99.33%	1'157'559.11	0.51	a)
XS2676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	104.76%	295'162.78	0.13	a)
XS2751598322	3.6250 % ENGSM 3 5/8 01/24/34 EMTN	0	500	0	500 EUR	99.74%	468'337.04	0.21	a)
<b>ES</b>							<b>10'745'172.19</b>	<b>4.78</b>	
US65559CAE12	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 144A	0	800	0	800 USD	93.90%	637'328.49	0.28	a)
XS2185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	500	0	0	500 EUR	97.96%	459'992.66	0.20	a)
<b>FI</b>							<b>1'097'321.15</b>	<b>0.49</b>	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29 OAT	2'700	240	860	2'080 EUR	112.17%	2'191'250.84	0.97	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35 OAT	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55 OAT	250	0	200	50 EUR	108.81%	51'096.52	0.02	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45 OAT	600	410	0	1'010 EUR	98.13%	930'845.13	0.41	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36 OAT	0	150	0	150 EUR	82.09%	115'644.07	0.05	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26 OAT	1'100	2'600	0	3'700 EUR	95.00%	3'301'159.09	1.47	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 OAT	1'400	30	820	610 EUR	83.03%	475'676.71	0.21	a)
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	500	0	0	500 EUR	92.59%	434'767.00	0.19	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52 OAT	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	0	360	0	360 EUR	66.30%	224'140.24	0.10	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30 OAT	0	1'110	0	1'110 EUR	84.80%	884'027.20	0.39	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	100	0	0	100 EUR	88.34%	82'965.75	0.04	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44 OAT	0	200	0	200 EUR	59.36%	111'500.05	0.05	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53 OAT	0	860	0	860 EUR	51.28%	414'158.03	0.18	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32 OAT	0	1'520	0	1'520 EUR	93.93%	1'340'820.35	0.60	a)
FR001400DNF5	5.3750 % ENFP 5 3/8 06/30/42	0	500	300	200 EUR	116.19%	218'246.11	0.10	a)
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	104.31%	293'889.29	0.13	a)
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFF 5 1/2 10/09/28 EMTN	0	600	0	600 EUR	106.55%	600'389.52	0.27	a)
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	100'000	100'000	0	200'000 JPY	99.91%	1'164'400.09	0.52	a)
US05581KAB70	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659W2P81	2.8710 % BNP 2.871 04/19/32 144A	0	700	0	700 USD	87.48%	519'556.84	0.23	a)
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	500	0	0	500 USD	98.76%	418'947.64	0.19	a)
XS2166619820	1.7500 % DSFIR 1 3/4 04/30/30	0	450	0	450 EUR	92.84%	392'376.43	0.17	a)
XS2451372499	1.2500 % AYVFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>FR</b>							<b>14'165'856.90</b>	<b>6.30</b>	
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	300	900	300	900 GBP	102.74%	1'031'015.45	0.46	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	360	625	985	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	800	0	490	310 GBP	105.64%	365'172.81	0.16	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	400	0	400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	600	595	190	1'005 GBP	104.05%	1'166'014.73	0.52	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	0	1'300	90	1'210 GBP	84.73%	1'143'185.12	0.51	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	900	0	700	200 GBP	59.96%	133'722.07	0.06	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	500	315	815	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	225	0	225 GBP	66.85%	167'718.77	0.07	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	900	0	900	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	700	780	0	1'480 GBP	64.14%	1'058'526.37	0.47	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US636274AE20	5.8090 % NGGLN 5.809 06/12/33	500	0	0	500 USD	104.88%	444'918.70	0.20	a)
US63859UBH59	1.5000 % NWDIE 1 1/2 10/13/26 144A	0	800	0	800 USD	93.98%	637'891.86	0.28	a)
US780097BG51	4.8920 % NWG 4.892 05/18/29	0	1'000	0	1'000 USD	100.27%	850'774.75	0.38	a)
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	500	0	0	500 USD	86.04%	364'990.46	0.16	a)
US92857WAB63	6.2500 % VOD 6 1/4 11/30/32	100	0	0	100 USD	109.61%	92'999.45	0.04	a)
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	100	0	0	100 USD	95.67%	81'172.06	0.04	a)
US92857WBZ23	5.7500 % VOD 5 3/4 02/10/63	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	600	0	0	600 USD	101.54%	516'889.32	0.23	a)
X51961843171	3.0000 % HSBC 3 07/22/28	700	0	0	700 GBP	94.44%	737'122.83	0.33	a)
X52044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	400	0	0	400 GBP	93.07%	415'106.89	0.18	a)
X52050806434	1.7500 % NGGLN 1 3/4 09/09/31 EMTN	0	700	0	700 GBP	80.42%	627'736.16	0.28	a)
X52351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	98.97%	576'716.77	0.26	a)
X52659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.09%	113'834.70	0.05	a)
X52669894821	6.1250 % NWDIE 6 1/8 08/21/28 EMTN	400	0	0	400 GBP	104.48%	466'030.16	0.21	a)
X52675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.39%	388'377.51	0.17	a)
X52690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	106.08%	99'623.52	0.04	a)
X52742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	0	500	0	500 EUR	101.29%	475'615.48	0.21	a)
<b>GB</b>							<b>11'955'155.94</b>	<b>5.32</b>	
USY5257YAL12	5.8310 % LENOVO 5.831 01/27/28 REGS	0	500	0	500 USD	102.68%	435'573.02	0.19	a)
<b>HK</b>							<b>435'573.02</b>	<b>0.19</b>	
X52309433899	1.7500 % CROATI 1 3/4 03/04/41	0	180	0	180 EUR	78.97%	133'488.45	0.06	a)
<b>HR</b>							<b>133'488.45</b>	<b>0.06</b>	
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	0	1'010	0	1'010 EUR	88.71%	841'492.19	0.37	a)
X51108784510	4.5000 % SRENVX 4 1/2 09/11/44	2'000	0	1'000	1'000 USD	99.90%	847'601.55	0.38	a)
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	600	0	0	600 USD	85.86%	437'102.77	0.19	a)
X52765559443	3.2000 % LIN 3.2 02/14/31	0	500	0	500 EUR	100.59%	472'351.92	0.21	a)
<b>IE</b>							<b>2'598'548.43</b>	<b>1.16</b>	
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	0	250	0	250 EUR	111.32%	261'371.10	0.12	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	0	45	45	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	2'000	890	2'890	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	2'000	790	0	2'790 EUR	90.96%	2'383'420.98	1.06	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	0	455	455	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	1'050	35	1'085	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	1'000	400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	3'100	2'700	4'430	1'370 EUR	96.75%	1'244'811.54	0.55	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	0	195	195	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	0	3'085	3'085	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	0	230	80	150 EUR	95.80%	134'959.17	0.06	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US465410AH18	6.8750 % ITALY 6 7/8 09/27/23	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.64%	439'721.03	0.20	a)
<b>IT</b>							<b>4'464'283.82</b>	<b>1.99</b>	
US90351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.98%	839'770.36	0.37	a)
X52242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	1'000	0	0	1'000 EUR	98.01%	920'417.33	0.41	a)
<b>JE</b>							<b>1'760'187.69</b>	<b>0.78</b>	
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	0	880'000	0	880'000 JPY	99.99%	5'127'257.54	2.28	a)
JP1024601Q58	0.3000 % JGB 0.3 05/01/26 460	0	1'700'000	100'000	1'600'000 JPY	99.94%	9'317'251.85	4.14	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	0	380'000	300'000	80'000 JPY	98.81%	460'594.92	0.20	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	250'000	0	250'000 JPY	97.77%	1'424'339.86	0.63	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	0	50'000	0	50'000 JPY	96.47%	281'071.63	0.13	a)
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	0	80'000	0	80'000 JPY	96.34%	449'085.29	0.20	a)
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	270'000	0	270'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	25'000	0	25'000 JPY	99.96%	145'619.94	0.06	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	1'185'000	1'000'000	295'000	1'890'000 JPY	100.10%	11'024'065.33	4.90	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	155'000	0	110'000	45'000 JPY	102.21%	268'010.55	0.12	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	620'000	0	470'000	150'000 JPY	104.38%	912'370.57	0.41	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	0	385'000	0	385'000 JPY	109.60%	2'458'700.72	1.09	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	40'000	300'000	300'000	40'000 JPY	104.49%	243'552.88	0.11	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	0	50'000	0	50'000 JPY	102.98%	300'030.01	0.13	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	70'000	0	30'000	40'000 JPY	92.83%	216'368.43	0.10	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	0	40'000	0	40'000 JPY	92.01%	214'452.49	0.10	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	0	25'000	0	25'000 JPY	84.46%	123'042.95	0.05	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	100'000	90'000	0	190'000 JPY	114.08%	1'262'973.72	0.56	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	355'000	0	35'000	320'000 JPY	107.21%	1'999'123.21	0.89	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	215'000	0	15'000	200'000 JPY	99.25%	1'156'685.05	0.51	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	0	60'000	0	60'000 JPY	79.18%	276'828.95	0.12	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	220'000	100'000	0	320'000 JPY	103.64%	1'932'517.46	0.86	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	100'000	0	0	100'000 JPY	96.22%	560'651.54	0.25	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	55'000	0	0	55'000 JPY	68.30%	218'897.09	0.10	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	0	30'000	0	30'000 JPY	74.83%	130'806.65	0.06	a)
JP316572BQ62	0.9670 % NTT 0.967 06/20/29 32	0	300'000	0	300'000 JPY	100.76%	1'761'406.72	0.78	a)
JP316572DQ60	1.4760 % NTT 1.476 03/17/34 34	0	300'000	0	300'000 JPY	101.90%	1'781'247.89	0.79	a)
US65535HAZ29	2.3290 % NOMURA 2.329 01/22/27	0	800	0	800 USD	94.49%	641'387.47	0.29	a)
US86562MBP41	3.0400 % SUMIBK 3.04 07/16/29	0	800	0	800 USD	93.07%	631'687.99	0.28	a)
US874060BL90	5.6500 % TACHEM 5.65 07/05/44	0	200	0	200 USD	102.10%	173'248.40	0.08	a)
US874060BM73	5.6500 % TACHEM 5.65 07/05/54	0	600	0	600 USD	102.07%	519'607.75	0.23	a)
US874060BN56	5.8000 % TACHEM 5.8 07/05/64	0	600	0	600 USD	102.25%	520'539.35	0.23	a)
X52459747874	1.8500 % EJRAIL 1.85 04/13/33 EMTN	600	0	0	600 EUR	89.52%	504'460.64	0.22	a)
X52891034063	3.5330 % EJRAIL 3.533 09/04/36 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.07%	187'954.66	0.08	a)
<b>JP</b>							<b>47'225'839.50</b>	<b>21.01</b>	
US88032XBD57	3.9400 % TENCNT 3.94 04/22/61 REGS	1'000	0	200	800 USD	76.70%	520'602.13	0.23	a)
<b>KY</b>							<b>520'602.13</b>	<b>0.23</b>	
X51310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	0	150	0	150 EUR	87.59%	123'394.90	0.05	a)
X52013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	150	15	40	125 EUR	66.99%	78'638.84	0.03	a)
<b>LT</b>							<b>202'033.74</b>	<b>0.09</b>	
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	500	0	300	200 EUR	58.77%	110'388.10	0.05	a)
X51769041606	1.7000 % NOVNVX 1.7 08/14/38	0	300	0	300 EUR	84.14%	237'058.29	0.11	a)
X51960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	225	400	0	625 EUR	83.49%	490'085.48	0.22	a)
X52238787415	0.0000 % MDT 0 10/15/25	0	400	0	400 EUR	96.48%	362'419.31	0.16	a)
X52286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.73%	73'936.73	0.03	a)
X52397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>1'273'887.91</b>	<b>0.57</b>	
X52361416915	0.0000 % LATVIA 0 01/24/29 GMTN	0	200	0	200 EUR	88.33%	165'903.33	0.07	a)
<b>LV</b>							<b>165'903.33</b>	<b>0.07</b>	
US02364WAJ45	6.3750 % AMXLMM 6 3/8 03/01/35	500	0	0	500 USD	110.94%	470'614.00	0.21	a)
US91087BAX82	6.3380 % MEX 6.338 05/04/53	0	1'500	0	1'500 USD	98.05%	1'247'832.38	0.56	a)
X52363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	0	400	200	200 EUR	77.72%	145'985.77	0.06	a)
<b>MX</b>							<b>1'864'432.15</b>	<b>0.83</b>	
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	500	0	0	500 AUD	96.16%	276'772.22	0.12	a)
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	0	500	0	500 USD	107.00%	453'903.78	0.20	a)
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	500	0	0	500 USD	97.96%	415'558.08	0.18	a)
X51026109204	4.0000 % FREGR 4 02/01/24 REGS	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	100.03%	848'738.47	0.38	a)
X51613121422	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 05/16/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X5170553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52014382845	0.8750 % ALLRNV 0 7/8 06/24/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	85.48%	802'769.58	0.36	a)
X52227050379	0.8750 % LUCSHI 0 7/8 09/08/32 EMTN	600	0	0	600 EUR	83.16%	468'616.91	0.21	a)
X52332689764	0.7500 % DNFSDC 0 3/4 04/28/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	83.30%	234'697.26	0.10	a)
X52475954579	1.8750 % PHIANA 1 7/8 05/05/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	96.70%	454'090.08	0.20	a)
X52498042584	3.3750 % NEGANV 3 3/8 07/11/34 EMTN	450	0	200	250 EUR	101.12%	237'427.38	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52589790018	3.6250 % SIEGR 3 5/8 02/24/43	0	500	0	500 EUR	99.31%	466'355.42	0.21	a)
X52715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	200	0	200 EUR	106.45%	199'945.77	0.09	a)
X52827697272	3.6250 % SCMNVX 3 5/8 11/29/36 EMTN	0	650	0	650 EUR	101.37%	618'812.90	0.28	a)
X52861026891	4.7500 % BNG 4 3/4 02/02/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	100.43%	1'119'903.69	0.50	a)
<b>NL</b>							<b>6'597'591.54</b>	<b>2.94</b>	
X52768793676	3.3750 % STATNE 3 3/8 02/26/36 EMTN	0	600	0	600 EUR	99.53%	560'815.48	0.25	a)
<b>NO</b>							<b>560'815.48</b>	<b>0.25</b>	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	600	1'200	0	1'800 NZD	98.78%	943'851.40	0.42	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	500	0	0	500 NZD	101.56%	269'556.87	0.12	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	600	0	0	600 NZD	96.32%	306'762.93	0.14	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	400	0	0	400 NZD	83.35%	176'977.51	0.08	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	500	350	850	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	400	0	0	400 NZD	99.76%	211'827.74	0.09	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	550	0	0	550 NZD	66.50%	194'137.48	0.09	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	400	0	0	400 NZD	70.28%	149'219.21	0.07	a)
<b>NZ</b>							<b>2'252'333.14</b>	<b>1.00</b>	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	200	0	0	200 USD	125.10%	212'283.89	0.09	a)
<b>PE</b>							<b>212'283.89</b>	<b>0.09</b>	
PTOTE5OE0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37 31Y	0	180	0	180 EUR	110.49%	186'787.48	0.08	a)
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45 30Y	0	160	0	160 EUR	110.11%	165'460.80	0.07	a)
PTOTECOEO0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52 31Y	250	20	70	200 EUR	57.31%	107'647.65	0.05	a)
PTOTENOEO0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35 15Y	0	180	0	180 EUR	80.49%	136'071.50	0.06	a)
PTOTEZOE0014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38 15Y	0	160	0	160 EUR	103.47%	155'481.74	0.07	a)
<b>PT</b>							<b>751'449.17</b>	<b>0.33</b>	
US83051GAU22	1.4000 % SEB 1.4 11/19/25 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86959LAP85	5.5000 % SHBASS 5 1/2 06/15/28 144A	500	0	0	500 USD	102.84%	436'289.96	0.19	a)
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87020PAV94	5.4720 % SWEDA 5.472 06/15/26 144A	400	0	0	400 USD	101.66%	345'017.10	0.15	a)
X51195216707	0.7500 % STOCKL 0 3/4 02/26/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52343459074	0.6250 % NDAFH 0 5/8 08/18/31 EMTN	500	0	0	500 EUR	94.83%	445'280.82	0.20	a)
X52442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	93.30%	438'115.08	0.19	a)
X52443485565	1.3000 % SWEDA 1.3 02/17/27 GMTN	0	500	0	500 EUR	95.50%	448'445.77	0.20	a)
<b>SE</b>							<b>2'113'148.73</b>	<b>0.94</b>	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	500	0	0	500 USD	99.30%	421'234.21	0.19	a)
US33938XAF24	5.2500 % FLEX 5 1/4 01/15/32	0	400	0	400 USD	99.98%	339'322.31	0.15	a)
US716973AH54	5.3400 % PFE 5.34 05/19/63	1'000	0	500	500 USD	99.23%	420'958.47	0.19	a)
<b>SG</b>							<b>1'181'514.99</b>	<b>0.53</b>	
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	0	305	0	305 EUR	86.28%	247'133.39	0.11	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	0	300	0	300 EUR	81.55%	229'761.07	0.10	a)
<b>SI</b>							<b>476'894.46</b>	<b>0.21</b>	
SK4000017059	1.0000 % SLOVGB 1 10/09/30 237	0	1'000	0	1'000 EUR	89.06%	836'400.66	0.37	a)
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	0	510	0	510 EUR	69.45%	332'653.03	0.15	a)
SK4000021986	4.0000 % SLOVGB 4 10/19/32 244	0	1'500	0	1'500 EUR	105.06%	1'480'068.26	0.66	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	0	1'155	0	1'155 EUR	89.13%	966'758.68	0.43	a)
<b>SK</b>							<b>3'615'880.63</b>	<b>1.61</b>	
US002824BB55	2.9500 % ABT 2.95 03/15/25	800	0	0	800 USD	99.02%	672'101.36	0.30	a)
US00724PAG46	4.9500 % ADBE 4.95 04/04/34	0	700	0	700 USD	103.28%	613'377.59	0.27	a)
US02665WDW82	2.0000 % HNDA 2 03/24/28 MTN	500	0	0	500 USD	92.21%	391'186.36	0.17	a)
US036752AZ60	5.3750 % ELV 5 3/8 06/15/34	0	700	0	700 USD	103.54%	614'945.53	0.27	a)
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	500	0	0	500 USD	88.33%	374'700.97	0.17	a)
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	700	0	0	700 USD	86.25%	512'233.87	0.23	a)
US037833EA41	2.5500 % AAPL 2.55 08/20/60	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05351WAA18	3.1500 % AGR 3.15 12/01/24	0	500	0	500 USD	99.36%	421'522.69	0.19	a)
US05351WAC73	3.2000 % AGR 3.2 04/15/25	0	700	0	700 USD	98.69%	586'116.90	0.26	a)
US05565EBK01	3.9000 % BMW 3.9 04/09/25 144A	500	0	0	500 USD	99.35%	421'476.02	0.19	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	500	0	0	500 USD	89.32%	378'913.53	0.17	a)
US08652BAB53	1.9500 % BBY 1.95 10/01/30	500	0	0	500 USD	86.32%	366'186.78	0.16	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	100	0	0	100 USD	88.26%	74'882.50	0.03	a)
US099724AQ98	5.4000 % BWA 5.4 08/15/34	0	500	0	500 USD	100.37%	425'790.39	0.19	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US125523CV04	5.2500 % CI 5 1/4 02/15/34	0	190	0	190 USD	102.08%	164'560.19	0.07	a)
US149123CB51	3.8030 % CAT 3.803 08/15/42	0	400	0	400 USD	85.40%	289'820.34	0.13	a)
US149123CE90	4.7500 % CAT 4 3/4 05/15/64	0	700	0	700 USD	93.10%	552'922.99	0.25	a)
US14913Q3B33	2.1500 % CAT 2.15 11/08/24 MTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	100	0	0	100 USD	99.45%	84'380.90	0.04	a)
US172967NE72	2.5200 % C 2.52 11/03/32	0	700	0	700 USD	85.38%	507'066.81	0.23	a)
US22822VBF76	4.9000 % CCI 4.9 09/01/29	0	200	0	200 USD	100.86%	171'140.85	0.08	a)
US244199BF15	3.9000 % DE 3.9 06/09/42	0	400	0	400 USD	87.22%	295'993.66	0.13	a)
US24703TAB26	4.0000 % DELL 4 07/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642BB85	6.3000 % EBAY 6.3 11/22/32	800	0	0	800 USD	109.43%	742'767.07	0.33	a)
US30161NAQ43	4.9500 % EXC 4.95 06/15/35	0	300	0	300 USD	98.18%	249'912.64	0.11	a)
US30303M8S40	4.3000 % META 4.3 08/15/29	0	200	0	200 USD	100.66%	170'809.95	0.08	a)
US30303M8T23	4.5500 % META 4.55 08/15/31	0	200	0	200 USD	100.95%	171'305.45	0.08	a)
US337738BM99	4.7500 % FI 4 3/4 03/15/30	0	463	0	463 USD	101.10%	397'169.22	0.18	a)
US36266GAA58	4.8000 % GEHC 4.8 08/14/29	0	400	0	400 USD	100.78%	342'033.95	0.15	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	500	0	0	500 USD	101.22%	429'392.06	0.19	a)
US37045XAS53	4.0000 % GM 4 01/15/25	800	0	0	800 USD	99.43%	674'918.22	0.30	a)
US375558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	800	0	0	800 USD	104.71%	710'736.38	0.32	a)
US38141GZP26	3.0000 % GS 3 03/15/24	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	800	0	0	800 USD	99.53%	675'542.68	0.30	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	800	0	0	800 USD	84.48%	573'409.66	0.26	a)
US478160CF96	3.6250 % JNJ 3 5/8 03/03/37	0	500	0	500 USD	90.85%	385'395.69	0.17	a)
US501044DS75	4.6000 % KR 4.6 08/15/27	0	250	0	250 USD	100.27%	212'680.96	0.09	a)
US501044DV05	5.0000 % KR 5 09/15/34	0	500	0	500 USD	99.70%	422'931.11	0.19	a)
US501044DW87	5.5000 % KR 5 1/2 09/15/54	0	500	0	500 USD	97.88%	415'218.70	0.18	a)
US532457CS55	5.0500 % LLY 5.05 08/14/54	0	400	0	400 USD	100.33%	340'496.56	0.15	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	600	500	0	1'100 USD	81.97%	765'031.24	0.34	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	500	0	0	500 USD	105.41%	447'158.60	0.20	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	200	0	0	200 USD	86.46%	146'717.37	0.07	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	2'000	500	1'000	1'500 USD	71.68%	912'240.71	0.41	a)
US595112BV48	6.7500 % MU 6 3/4 11/01/29	500	0	0	500 USD	108.77%	461'416.81	0.21	a)
US609207BE44	4.7500 % MDLZ 4 3/4 08/28/34	0	300	0	300 USD	99.42%	253'068.88	0.11	a)
US61747YFS90	5.0420 % MS 5.042 07/19/30	0	1'000	0	1'000 USD	101.68%	862'670.02	0.38	a)
US61747YFT73	5.3200 % MS 5.32 07/19/35	0	1'000	0	1'000 USD	102.13%	866'547.44	0.39	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	300	0	0	300 USD	95.53%	243'162.38	0.11	a)
US66989HAS76	2.7500 % NOVNVX 2 3/4 08/14/50	0	600	0	600 USD	68.68%	349'644.55	0.16	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	600	0	0	600 USD	92.84%	472'600.23	0.21	a)
US713448FT00	4.6500 % PEP 4.65 02/15/53	0	600	0	600 USD	94.37%	480'419.54	0.21	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	1'000	0	0	1'000 USD	83.15%	705'503.14	0.31	a)
US742718GF07	4.3500 % PG 4.35 01/29/29	0	500	0	500 USD	101.62%	431'084.72	0.19	a)
US742718GG89	4.5500 % PG 4.55 01/29/34	0	500	0	500 USD	101.92%	432'370.12	0.19	a)
US74762EAK82	4.7500 % PWR 4 3/4 08/09/27	0	400	0	400 USD	100.47%	340'975.09	0.15	a)
US756109CQ54	5.3750 % O 5 3/8 09/01/54	0	250	0	250 USD	98.57%	209'085.65	0.09	a)
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	800	0	0	800 USD	95.25%	646'525.69	0.29	a)
US771196CH33	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 144A	0	500	0	500 USD	107.36%	455'439.48	0.20	a)
US776696AH96	4.7500 % ROP 4 3/4 02/15/32	0	200	0	200 USD	99.93%	169'569.52	0.08	a)
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	800	0	500	300 USD	80.60%	205'150.12	0.09	a)
US882508BQ64	4.1000 % TXN 4.1 08/16/52	0	300	0	300 USD	86.42%	219'956.42	0.10	a)
US882508CJ13	5.1500 % TXN 5.15 02/08/54	0	700	0	700 USD	101.13%	600'632.18	0.27	a)
US89236TMK87	4.5500 % TOYOTA 4.55 08/09/29	0	800	0	800 USD	100.79%	684'115.42	0.30	a)
US904764BU02	4.2500 % UNANA 4 1/4 08/12/27	0	200	0	200 USD	100.37%	170'311.07	0.08	a)
US904764BV84	4.6250 % UNANA 4 5/8 08/12/34	0	200	0	200 USD	100.20%	170'027.68	0.08	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	0	4'400	1'600	2'800 USD	69.84%	1'659'250.03	0.74	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	3'300	3'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	0	850	0	850 USD	64.11%	462'345.60	0.21	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	0	850	200	650 USD	66.39%	366'139.32	0.16	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	0	850	300	550 USD	69.48%	324'247.10	0.14	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	3'810	3'810	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	0	1'900	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	200	0	0	200 USD	71.78%	121'806.88	0.05	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	600	500	0	1'100 USD	90.59%	845'453.27	0.38	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	59.64%	506'032.55	0.23	a)
US92928QAF54	3.5000 % URWFP 3 1/2 06/15/29 144A	0	0	0	500 USD	92.59%	392'806.90	0.17	a)
US95000U2Z51	4.6110 % WFC 4.611 04/25/53 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	90.53%	768'110.27	0.34	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	700	0	0	700 USD	99.02%	588'112.45	0.26	a)
US983024AN02	5.9500 % PFE 5.95 04/01/37	0	300	0	300 USD	109.29%	278'176.21	0.12	a)
USU24652AT35	3.3500 % HOG 3.35 06/08/25 REGS	0	500	0	500 USD	98.29%	416'953.78	0.19	a)
XS1405775708	0.7500 % TMO 0 3/4 09/12/24	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1718480327	0.3750 % UPS 0 3/8 11/15/23	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1835955474	1.8120 % JPM 1.812 06/12/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.06%	892'721.69	0.40	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	100	0	0	100 EUR	97.80%	91'852.02	0.04	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1914485534	1.1250 % SYK 1 1/8 11/30/23	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	500	0	0	500 EUR	93.95%	441'143.85	0.20	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	300	0	0	300 EUR	80.26%	226'115.28	0.10	a)
XS2363117321	0.3000 % HNDA 0.3 07/07/28	1'000	0	500	500 EUR	89.80%	421'689.29	0.19	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	300	500	200	600 EUR	83.09%	468'183.02	0.21	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	100'000	0	0	100'000 JPY	100.11%	583'330.50	0.26	a)
XS2680745382	4.6680 % NGGLN 4.668 09/12/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	105.85%	298'236.63	0.13	a)
XS2865533462	3.9000 % WFC 3.9 07/22/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.08%	189'849.87	0.08	a)
<b>US</b>							<b>36'878'021.11</b>	<b>16.41</b>	
AU3CB0258598	3.3500 % EUROF 3.35 05/21/29 MTN	500	0	0	500 AUD	95.81%	275'770.55	0.12	a)
AU3CB0271914	1.5000 % IFC 1 1/2 04/15/35 MTN	500	0	0	500 AUD	73.79%	212'397.55	0.09	a)
CA459058HF31	1.9500 % IBRD 1.95 09/20/29	0	900	0	900 CAD	93.84%	531'693.45	0.24	a)
CA459058JD64	0.7500 % IBRD 0 3/4 07/02/25 GDIF	0	700	0	700 CAD	97.43%	429'346.23	0.19	a)
CA459058JK08	0.8750 % IBRD 0 7/8 09/28/27	0	1'500	0	1'500 CAD	93.00%	878'167.00	0.39	a)
CA459058JY02	1.2000 % IBRD 1.2 07/22/26	0	1'100	0	1'100 CAD	95.89%	664'001.91	0.30	a)
CA459058KF93	1.8000 % IBRD 1.8 01/19/27	0	50	0	50 CAD	96.46%	30'361.01	0.01	a)
CA459058KV44	4.2500 % IBRD 4 1/4 09/18/30	0	800	0	800 CAD	104.99%	528'765.50	0.24	a)
EU000A19VVY6	0.5000 % EU 0 1/2 04/04/25 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1U9928	1.6250 % ESM 1 5/8 11/17/36 EMTN	400	400	400	400 EUR	87.34%	328'083.86	0.15	a)
EU000A3K4D74	3.3750 % EU 3 3/8 10/04/38 NGEU	0	100	0	100 EUR	102.99%	96'719.66	0.04	a)
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	0	500	0	500 EUR	88.08%	413'593.78	0.18	a)
EU000A3K4DJ5	0.8000 % EU 0.8 07/04/25 NGEU	0	100	0	100 EUR	98.15%	92'180.73	0.04	a)
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	0	500	0	500 EUR	89.80%	421'670.50	0.19	a)
EU000A3K4D56	2.0000 % EU 2 10/04/27 NGEU	0	100	0	100 EUR	98.43%	92'438.99	0.04	a)
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	100	0	100 EUR	101.99%	95'781.44	0.04	a)
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	0	360	0	360 EUR	93.86%	317'326.05	0.14	a)
EU000A3KNYF7	0.0000 % EU 0 03/04/26 SURE	0	260	150	110 EUR	96.30%	99'483.49	0.04	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	0	500	0	500 EUR	64.82%	304'384.33	0.14	a)
EU000A3LNF05	3.1250 % EU 3 1/8 12/04/30 NGEU	0	600	0	600 EUR	102.68%	578'576.75	0.26	a)
US045167CW12	2.0000 % ASIA 2 01/22/25 GMTN	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JA59	1.6250 % EIB 1 5/8 10/09/29	0	2'500	0	2'500 USD	89.91%	1'906'997.43	0.85	a)
US4581X0BX51	3.2000 % IADB 3.2 08/07/42	14'900	300	12'700	2'500 USD	84.16%	1'785'117.59	0.79	a)
US4581X0CE61	4.3750 % IADB 4 3/8 01/24/44	2'600	0	2'000	600 USD	97.98%	498'786.79	0.22	a)
US4581X0DG01	2.2500 % IADB 2 1/4 06/18/29	0	2'500	0	2'500 USD	93.15%	1'975'743.09	0.88	a)
US4581X0DJ40	2.0000 % IADB 2 07/23/26	0	5'000	0	5'000 USD	96.30%	4'085'074.64	1.82	a)
US4581X0DQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	0	3'300	0	3'300 USD	90.83%	2'543'107.55	1.13	a)
US4581X0DS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	700	4'600	0	5'300 USD	84.42%	3'796'140.93	1.69	a)
US4581X0DV77	0.8750 % IADB 0 7/8 04/20/26 GMTN	0	1'000	0	1'000 USD	94.92%	805'382.68	0.36	a)
US4581X0DX34	1.1250 % IADB 1 1/8 07/20/28	0	5'800	0	5'800 USD	90.39%	4'447'854.89	1.98	a)
US4581X0DZ81	0.5000 % IADB 0 1/2 09/23/24	6'000	1'500	7'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0EB05	1.5000 % IADB 1 1/2 01/13/27	0	2'000	0	2'000 USD	94.52%	1'603'909.88	0.71	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	4'000	2'500	3'500	3'000 USD	96.26%	2'450'077.55	1.09	a)
US459058EP48	2.5000 % IBRD 2 1/2 07/29/25 GDIF	7'000	500	7'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058FT50	1.8750 % IBRD 1 7/8 10/27/26 GDIF	1'000	2'000	1'000	2'000 USD	95.71%	1'624'069.05	0.72	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	0	2'200	0	2'200 USD	85.78%	1'601'104.90	0.71	a)
US459058KT95	3.5000 % IBRD 3 1/2 07/12/28	4'700	0	0	4'700 USD	98.88%	3'942'932.96	1.75	a)
US45950KDA51	3.6250 % IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN	2'000	500	0	2'500 USD	99.26%	2'105'449.89	0.94	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	1'000	0	0	1'000 USD	98.60%	836'537.76	0.37	a)
XS2122575678	1.0000 % IBRD 1 12/21/29	0	850	0	850 GBP	85.86%	813'783.71	0.36	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	1'270	0	1'270 EUR	95.75%	1'141'974.43	0.51	a)
<b>XS</b>							<b>44'354'788.50</b>	<b>19.73</b>	

## Derivative Finanzinstrumente

**1'818'924.18 0.81**

### Devisentermingeschäfte

EUR/CHF Verfall 07.09.2023	46'467'382	48'720'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 07.09.2023	18'643'648	32'000'000	CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 07.09.2023	68'197'150	78'970'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 07.09.2023	9'173'699	8'255'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 07.09.2023	5'963'303	9'085'000	CHF/CAD	0.00	0.00
NZD/CHF Verfall 07.09.2023	1'905'335	3'545'000	CHF/NZD	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 07.09.2023	25'422'176	4'160'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 07.09.2023	1'223'869	1'400'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 07.09.2023	1'654'871	270'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 07.09.2023	2'048'447	3'600'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 07.09.2023	500'000	438'743	USD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 07.09.2023	356'438	320'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 07.09.2023	200'000	190'875	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 07.09.2023	600'000	527'393	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 07.09.2023	2'121'173	2'400'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 12.10.2023	26'722'070	4'430'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 12.10.2023	5'905'177	9'085'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 12.10.2023	46'106'518	48'520'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 12.10.2023	72'351'616	81'670'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 12.10.2023	9'538'204	8'575'000	CHF/GBP	0.00	0.00
NZD/CHF Verfall 12.10.2023	1'845'694	3'545'000	CHF/NZD	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 12.10.2023	20'129'486	35'600'000	CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 12.10.2023	1'070'419	1'200'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 12.10.2023	535'501	600'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 12.10.2023	200'000	191'582	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY Verfall 12.10.2023	30'000'000	181'955	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 12.10.2023	250'000	166'503	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 12.10.2023	1'100'000	1'007'360	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 12.10.2023	700'000	677'410	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD Verfall 12.10.2023	500'000	293'700	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 12.10.2023	900'000	826'978	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD Verfall 12.10.2023	240'000	139'177	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/NZD Verfall 12.10.2023	200'000	108'226	NZD/CHF	0.00	0.00
NZD/CHF Verfall 02.11.2023	1'821'680	3'345'000	CHF/NZD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.11.2023	73'619'958	81'470'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 02.11.2023	9'500'080	8'575'000	CHF/GBP	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 02.11.2023	26'803'524	4'400'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 02.11.2023	5'873'128	8'835'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.11.2023	45'643'103	47'620'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 02.11.2023	20'215'941	34'860'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 02.11.2023	500'000	479'346	EUR/CHF	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 02.11.2023	548'146	90'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 02.11.2023	850'000	941'901	GBP/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 02.11.2023	231'919	400'000	CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.11.2023	1'986'796	2'200'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.11.2023	1'328'828	1'400'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/JPY Verfall 02.11.2023	120'000'000	726'192	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 02.11.2023	800'000	717'534	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD Verfall 02.11.2023	700'000	398'468	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 02.11.2023	300'000	283'709	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 02.11.2023	700'000	627'134	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 02.11.2023	1'800'000	1'624'937	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 02.11.2023	1'400'000	1'337'176	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY Verfall 02.11.2023	50'000'000	302'685	JPY/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.12.2023	72'892'777	80'370'000	CHF/USD	0.00	0.00
NZD/CHF Verfall 04.12.2023	1'764'782	3'345'000	CHF/NZD	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 04.12.2023	26'001'086	4'320'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 04.12.2023	8'503'332	7'725'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 04.12.2023	5'774'521	8'835'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 04.12.2023	44'943'361	46'820'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 04.12.2023	19'866'643	34'560'000	CHF/AUD	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 04.12.2023	601'757	100'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 04.12.2023	350'000	228'907	CAD/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		800'000	462'428	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		722'726	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		768'278	800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		232'255	400'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		627'249	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		110'422	170'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		299'149	520'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		795'979	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		480'838	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		264'434	45'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		231'136	210'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		162'225	280'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		441'411	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		623'916	650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		254'804	440'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		699'605	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		72'786'713	84'070'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		1'789'093	3'345'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		26'311'218	4'465'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		8'700'148	7'935'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		46'151'490	48'770'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		20'347'885	35'400'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'530'225	8'655'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		2'784'752	3'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		609'104	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		705'297	750'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		565'687	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'209'039	1'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		570'329	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		297'601	270'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		231'716	360'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		80'367	150'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		405'381	700'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		427'626	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		564'344	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		194'830	180'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		51'400	80'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		139'360	240'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		301'595	50'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		200'661	350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		34'503	65'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		400'000	340'874	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		400'000	371'830	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		17'000'000	100'985	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		110'000	118'397	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		400'000	228'897	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.01.2024		100'000	63'855	CAD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		1'886'116	3'560'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		26'597'664	4'498'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		76'036'437	89'470'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		8'935'519	8'275'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		20'632'135	36'290'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		47'295'769	50'920'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		5'705'717	8'995'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		532'340	570'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		500'000	433'890	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		450'000	424'025	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		250'000	274'938	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		120'000	77'073	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		390'000	221'976	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		60'000	31'811	NZD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		7'429'754	1'270'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		13'200'000	7'514'522	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		1'398'209	1'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		1'885'869	2'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		430'598	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		5'183'147	880'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		596'886	640'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		8'900'000	5'019'600	AUD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		327'693	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		79'619'887	91'670'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		9'054'853	8'325'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		38'981'146	6'648'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		1'838'015	3'500'000	CHF/NZD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		49'606'676	53'180'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		5'696'064	8'875'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		7'765'826	13'800'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		800'000	694'986	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		250'000	233'253	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		2'021'916	2'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		1'425'825	1'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		374'287	690'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		432'510	390'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		845'940	1'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		1'254'639	214'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.03.2024		1'950'000	1'124'717	AUD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		568'005	510'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		614'624	700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		659'207	750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		82'906'044	94'620'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		52'190'260	54'430'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		10'339'491	9'225'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		40'776'749	6'862'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		6'876'200	11'850'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.04.2024		2'264'242	4'190'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		6'617'820	10'175'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		700'816	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		410'000'000	2'436'909	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.04.2024		1'380'000	800'959	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		1'438'580	1'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		1'525'663	1'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		87'594'470	97'120'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2024		2'278'962	4'190'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		38'508'375	6'452'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		10'524'480	9'225'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		54'813'525	55'930'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		6'758'947	10'175'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		6'238'099	10'470'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		2'000'000	1'804'238	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		2'250'000	2'205'560	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		900'000	819'691	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		380'000	370'958	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		50'000'000	290'879	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2024		280'000	186'964	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		75'000	85'406	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		250'000	149'118	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		2'334'248	400'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		1'085'234	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		86'950'775	96'270'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 13.06.2024		2'257'606	4'147'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		42'382'543	7'210'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		10'772'364	9'500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		52'603'830	53'962'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		6'672'003	10'101'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		6'204'100	10'367'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2024		450'000	406'323	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.06.2024		600'000	587'550	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		4'906'328	850'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 13.06.2024		160'000	184'050	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		978'414	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		1'258'416	1'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		86'864'744	96'920'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		2'277'064	4'147'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		46'117'869	8'060'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		10'642'743	9'340'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		52'603'210	54'662'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		6'576'842	10'101'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		6'133'273	10'367'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		962'146	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		664'930	700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		852'232	960'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		292'405	260'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		400'000	353'001	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		350'000	336'888	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		1'076'802	1'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		600'000	541'957	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		150'000	171'648	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		10'000'000	55'971	JPY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		200'000	194'009		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		627'661	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		485'785	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		88'715'279	98'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 09.08.2024		2'302'388	4'224'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		44'830'450	8'050'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		11'052'471	9'610'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		54'712'007	56'312'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		6'737'308	10'231'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		6'306'625	10'427'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		2'028'770	2'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		667'899	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		351'860	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		333'228	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		1'016'932	900'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		891'645	1'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		767'572	680'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 09.08.2024		400'000	229'763		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		891'505	1'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		686'974	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		848'568	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		232'941	250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		214'603	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		600'000	511'573		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 09.08.2024		800'000	866'885		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 09.08.2024		1'400'000	864'539		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		1'774'291	3'200'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		88'643'980	102'880'000		CHF/USD	1'494'382.63	0.66	b)
	NZD/CHF Verfall 13.09.2024		2'190'026	4'224'000		CHF/NZD	-48'776.87	-0.02	b)
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		48'128'699	8'190'000'000		CHF/JPY	387'127.24	0.17	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		11'393'290	10'390'000		CHF/GBP	-175'121.48	-0.08	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		54'665'368	57'952'000		CHF/EUR	293'012.19	0.13	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		7'422'434	11'811'000		CHF/CAD	-4'005.64	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		8'608'600	15'227'000		CHF/AUD	-146'228.27	-0.07	b)
	CHF/USD Verfall 13.09.2024		900'000	775'600		USD/CHF	-13'210.59	-0.01	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		955'090	1'100'000		CHF/USD	23'277.96	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		940'273	1'100'000		CHF/USD	8'467.01	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>1'818'924.18</b>	<b>0.81</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'160'088.05	0.96
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	219'038'862.42	97.44
Derivative Finanzinstrumente	1'818'924.18	0.81
Sonstige Vermögenswerte	1'768'605.89	0.79
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>224'786'480.54</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-9'175.91	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>224'777'304.63</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	219'038'862.42	97.44
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	1'818'924.18	0.81
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57567333
CAD	1 = CHF	0.62953070
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
JPY	100 = CHF	0.58270700
NZD	1 = CHF	0.53083274
USD	1 = CHF	0.84845000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	763'605.00	0.340
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	221'333'685.35	98.468

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

Periode: 01.09.2023 - 31.08.2024

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

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.09.2023 - 31.08.2024

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % Max
A	0.900	1.000	-
B	0.900	1.000	-
It	0.330	0.600	-
Nt	0.030	0.200	-

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

## 8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Excluding Securitized Total Return Index hedged CHF

## 9 TER

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



## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Ja	CHF	1.30000	0.45500	0.84500

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Ja	CHF	1.427	0.499	0.928
It	Ja	CHF	1.969	0.689	1.280
Nt	Ja	CHF	2.199	0.769	1.430

## 12 Fussnoten

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

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

bestimmt.

Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

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