



BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL UNTERNEHMENSANLEIHEN

Halbjahresbericht per 29.02.2024

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

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

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 26.04.2024

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	22
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	22
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	22
7	Verwaltungskommission	23
8	Benchmark	23
9	TER	23
10	Fussnoten	24
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	25

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	29.02.2024	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		194'934'166.97	216'258'253.68	238'327'186.88	315'060'973.10
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'975'686.78	13'801'334.16	16'592'397.12	21'865'916.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		176'071.000	188'334.000	204'241.000	224'584.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.70	73.28	81.24	97.36
Ausschüttung je Anteil		-	1.70	1.95	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse A hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'611'936.26	24'626'422.14	28'736'778.31	41'562'184.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		323'423.090	334'839.090	368'122.818	431'485.627
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.01	73.55	78.06	96.32
Ausschüttung je Anteil		-	1.60	1.90	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'296'736.22	6'670'569.23	7'840'057.52	10'402'760.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		76'284.613	82'522.613	88'967.000	99'898.252
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.54	80.83	88.12	104.13
Thesaurierung je Anteil		-	1.86	2.04	2.03
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse B hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'747'111.17	9'011'003.79	10'397'685.27	18'565'109.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		107'203.942	111'169.895	122'838.000	179'947.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.59	81.06	84.65	103.17
Thesaurierung je Anteil		-	1.78	1.96	1.98
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'490'954.17	3'514'163.25	3'394'278.18	4'346'122.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		39'964.679	41'114.679	36'553.534	39'755.534
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.35	85.47	92.86	109.32
Thesaurierung je Anteil		-	2.46	2.72	2.74
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
Klasse It hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'004'147.63	6'062'729.80	6'106'350.10	7'997'325.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		70'981.000	72'206.000	69'846.000	75'276.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.59	83.96	87.43	106.24
Thesaurierung je Anteil		-	2.32	2.57	2.64
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %

Klasse Nt	CHF			
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode	24'824'141.26	31'567'037.01	35'450'023.58	42'174'095.80
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	272'287.862	354'012.852	366'609.917	371'192.076
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	91.17	89.17	96.70	113.62
Thesaurierung je Anteil	-	2.84	3.14	3.18
Total Expense Ratio (TER)	0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

Klasse Nt hedged	CHF			
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode	108'983'453.48	121'004'994.30	129'809'616.80	168'147'458.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	1'266'956.495	1'418'252.686	1'465'545.213	1'567'074.702
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	86.02	85.32	88.57	107.30
Thesaurierung je Anteil	-	2.65	2.94	3.03
Total Expense Ratio (TER)	0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	2.93 %	-0.93 %	-17.60 %	-1.38 %
Klasse A hedged	1.44 %	3.64 %	-18.87 %	-3.38 %
Klasse B	2.94 %	-0.92 %	-17.59 %	-1.38 %
Klasse B hedged	1.42 %	3.60 %	-18.87 %	-3.39 %
Klasse It	3.23 %	-0.35 %	-17.13 %	-0.82 %
Klasse It hedged	1.72 %	4.16 %	-18.49 %	-2.86 %
Klasse Nt	3.38 %	-0.07 %	-16.87 %	-0.52 %
Klasse Nt hedged	1.91 %	4.60 %	-18.12 %	-2.48 %
Benchmark Hedge	1.67 %	3.87 %	-16.79 %	-
Benchmark	3.34 %	-0.62 %	-15.68 %	-0.23 %
Tracking Error 33)	-	0.51 %	0.99 %	0.31 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse A	-0.41 %
Klasse A hedged	-0.23 %
Klasse B	-0.40 %
Klasse B hedged	-0.25 %
Klasse It	-0.11 %
Klasse It hedged	0.05 %
Klasse Nt	0.04 %
Klasse Nt hedged	0.24 %

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)	29.02.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	370'018.62	2'096'903.70
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	194'439'551.93	214'221'957.20
Derivative Finanzinstrumente	-2'221'663.36	-2'436'292.89
Sonstige Vermögenswerte	2'390'473.35	2'425'090.35
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	194'978'380.54	216'307'658.36
Andere Verbindlichkeiten	-44'213.57	-49'404.68
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	194'934'166.97	216'258'253.68

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Klasse A			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		188'334.000	204'241.000
Ausgegebene Anteile		750.000	2'760.000
Zurückgenommene Anteile		-13'013.000	-18'667.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		176'071.000	188'334.000
Klasse A hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		334'839.090	368'122.818
Ausgegebene Anteile		4'729.000	3'873.000
Zurückgenommene Anteile		-16'145.000	-37'156.728
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		323'423.090	334'839.090
Klasse B			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		82'522.613	88'967.000
Ausgegebene Anteile		892.000	4'318.613
Zurückgenommene Anteile		-7'130.000	-10'763.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		76'284.613	82'522.613
Klasse B hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		111'169.895	122'838.000
Ausgegebene Anteile		555.000	120.000
Zurückgenommene Anteile		-4'520.953	-11'788.105
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		107'203.942	111'169.895
Klasse It			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		41'114.679	36'553.534
Ausgegebene Anteile		-	4'561.145
Zurückgenommene Anteile		-1'150.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		39'964.679	41'114.679
Klasse It hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		72'206.000	69'846.000
Ausgegebene Anteile		-	2'360.000
Zurückgenommene Anteile		-1'225.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		70'981.000	72'206.000
Klasse Nt			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		354'012.852	366'609.917
Ausgegebene Anteile		-	7'812.029
Zurückgenommene Anteile		-81'724.990	-20'409.094
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		272'287.862	354'012.852
Klasse Nt hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'418'252.686	1'465'545.213
Ausgegebene Anteile		42'837.164	149'425.328
Zurückgenommene Anteile		-194'133.355	-132'717.855
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-64'000.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'266'956.495	1'418'252.686

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		216'258'253.68	238'327'186.88
Ausbezahlte Ausschüttung		-830'749.34	-1'073'818.40
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'822'626.84	-2'154'191.93
Saldo aus dem Anteilverkehr		-22'844'100.83	-9'609'019.21
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		4'173'390.30	-9'231'903.66
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		194'934'166.97	216'258'253.68

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		14'861.85	34'878.88
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'551.47	-483.24
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'717'969.33	6'954'357.13
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		36'044.81	181'693.14
Total Ertrag		3'767'324.52	7'170'445.91
Aufwand			
Passivzinsen		-3'077.20	-2.95
Reglementarische Vergütungen		-280'553.09	-618'020.77
Sonstige Aufwendungen		0.00	-1.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-298'734.44	-299'727.40
Total Aufwand		-582'364.73	-917'752.27
Nettoertrag / Verlust		3'184'959.79	6'252'693.64
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-11'721'249.56	-12'705'303.35
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		61'760.49	51'390.79
Realisierter Erfolg		-8'474'529.28	-6'401'218.92
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		12'647'919.58	-2'830'684.74
Gesamterfolg		4'173'390.30	-9'231'903.66

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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							194'439'551.93	99.72	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							194'439'551.93	99.72	
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	0	50	0	50 EUR	75.57%	36'004.70	0.02	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	0	50	0	50 EUR	45.67%	21'759.09	0.01	a)
XS2106056653	0.2500 % RBAV 0 1/4 01/22/25 EMTN	0	400	0	400 EUR	96.72%	368'662.96	0.19	a)
AT							426'426.75	0.22	
AU000XCLWA18	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	2'000	0	1'920	80 AUD	101.01%	46'332.89	0.02	a)
AU3CB0302719	5.3500 % VW 5.35 09/15/26 MTN	0	1'100	0	1'100 AUD	100.00%	630'726.06	0.32	a)
US00205GAC15	5.0000 % APAAU 5 03/23/35 144A	1'000	0	0	1'000 USD	92.73%	816'514.60	0.42	a)
US55607PAG00	2.6910 % MQGAU 2.691 06/23/32 144A	1'000	0	0	1'000 USD	82.24%	724'130.45	0.37	a)
US55608IAZ12	2.8710 % MQGAU 2.871 01/14/33 144A	0	1'000	0	1'000 USD	82.11%	722'998.19	0.37	a)
US89400PAE34	4.1250 % TCLAU 4 1/8 02/02/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	97.41%	2'573'311.20	1.32	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	97.21%	1'712'035.75	0.88	a)
XS2315784715	0.7500 % APAAU 0 3/4 03/15/29 EMTN	450	0	0	450 EUR	85.59%	367'016.37	0.19	a)
XS2575952937	3.7990 % WSTP 3.799 01/17/30 EMTN	1'400	0	400	1'000 EUR	101.60%	968'167.63	0.50	a)
AU							8'561'233.14	4.39	
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	85.37%	976'160.42	0.50	a)
BE							976'160.42	0.50	
CA06368BTX69	3.1900 % BMO 3.19 03/01/28 DPNT	1'940	0	0	1'940 CAD	95.72%	1'205'498.45	0.62	a)
CA07813ZCG78	3.0000 % BCECN 3 03/17/31 MTN	400	0	0	400 CAD	89.25%	231'763.03	0.12	a)
CA11282ZAP32	4.2900 % BAMREP 4.29 11/05/49 MTN	0	500	0	500 CAD	85.32%	276'953.08	0.14	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	1'300	0	1'300	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	0	400	0	400 CAD	100.96%	262'177.78	0.13	a)
CA44810ZAS98	4.8900 % HYDONE 4.89 03/13/37 MTN	500	0	0	500 CAD	101.66%	329'985.81	0.17	a)
CA628153AA60	3.6300 % CANMFA 3.63 06/01/29 A	2'100	0	0	2'100 CAD	98.73%	1'346'001.07	0.69	a)
CA87971MAS22	4.4000 % TCN 4.4 04/01/43 MTN	250	0	0	250 CAD	87.74%	142'408.43	0.07	a)
CA87971MBV42	2.8500 % TCN 2.85 11/13/31 CAF	400	0	0	400 CAD	86.88%	225'610.78	0.12	a)
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	1'940	0	140	1'800 CAD	99.98%	1'168'312.98	0.60	a)
US06417XAP69	4.8500 % BNS 4.85 02/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	98.64%	868'571.83	0.45	a)
US13645RAX26	6.1250 % CP 6 1/8 09/15/2115	200	0	0	200 USD	105.11%	185'101.42	0.09	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89352HBA68	4.1000 % TRPCN 4.1 04/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	93.67%	824'768.07	0.42	a)
XS1945965611	0.8750 % CPPIBC 0 7/8 02/06/29 EMTN	800	0	0	800 EUR	90.22%	687'753.11	0.35	a)
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	0	1'000	500	500 EUR	92.05%	438'555.05	0.22	a)
CA							8'193'460.89	4.20	
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
USH42097EN39	6.2460 % UBS 6.246 09/22/29 REGS	0	200	0	200 USD	102.78%	180'997.05	0.09	a)
USH42097EQ69	6.3010 % UBS 6.301 09/22/34 REGS	0	250	0	250 USD	103.43%	227'690.42	0.12	a)
CH							408'687.47	0.21	
XS1084942470	2.2500 % CDEL 2 1/4 07/09/24 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	99.18%	1'890'120.41	0.97	a)
XS1346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388560604	0.5550 % CHILE 0.555 01/21/29	2'000	0	0	2'000 EUR	86.45%	1'647'535.36	0.84	a)
CL							3'537'655.77	1.81	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	0	1'150	1'150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	0	2'100	1'310	790 EUR	74.17%	558'312.76	0.29	a)
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	780	780	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	93.58%	891'698.74	0.46	a)
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	800	0	0	800 USD	99.46%	700'621.94	0.36	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	0	400	0	400 USD	100.00%	352'226.53	0.18	a)
XS0460071078	5.5200 % DB 5.52 09/01/28 EMTN	0	400	0	400 USD	100.69%	354'635.33	0.18	a)
XS2396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2484327999	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 05/24/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.03%	177'301.10	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE							3'034'796.40	1.56	
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	700	0	0	700 GBP	91.05%	709'897.80	0.36	a)
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	3'000	0	1'320	1'680 GBP	103.82%	1'942'790.86	1.00	a)
DK							2'652'688.66	1.36	
US05964HAF29	3.8000 % SANTAN 3.8 02/23/28	2'000	0	0	2'000 USD	94.19%	1'658'803.79	0.85	a)
XS1201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	1'000	0	300	700 EUR	98.41%	656'439.45	0.34	a)
XS2645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	99.33%	584'409.74	0.30	a)
XS2676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	700	0	0	700 EUR	102.83%	685'908.33	0.35	a)
XS2751598322	3.6250 % ENGSM 3 5/8 01/24/34 EMTN	0	800	0	800 EUR	97.79%	745'436.86	0.38	a)
ES							4'330'998.17	2.22	
US65559CAE12	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 144A	800	0	0	800 USD	90.71%	639'031.66	0.33	a)
XS2185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	650	0	0	650 EUR	96.44%	597'324.48	0.31	a)
FI							1'236'356.14	0.63	
AU3CB0252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	2'000	0	0	2'000 AUD	94.53%	1'084'036.50	0.56	a)
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	600	0	0	600 EUR	90.34%	516'512.34	0.26	a)
FR0013464963	4.5000 % EDF 4 1/2 12/04/69 EMTN	600	0	0	600 USD	71.72%	378'901.69	0.19	a)
FR0013515749	1.2500 % BFCM 1 1/4 06/03/30	900	0	0	900 EUR	85.13%	730'036.36	0.37	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	800	0	0	800 EUR	86.40%	658'648.24	0.34	a)
FR0014000717	0.6250 % BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN	900	0	0	900 EUR	80.46%	689'995.24	0.35	a)
FR0014007LK5	0.8750 % BNP 0 7/8 07/11/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	85.33%	1'626'209.83	0.83	a)
FR001400DNF5	5.3750 % ENFP 5 3/8 06/30/42	0	1'000	700	300 EUR	117.16%	334'922.31	0.17	a)
FR001400EHG3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 12/06/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	100.57%	958'276.80	0.49	a)
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	700	0	200	500 EUR	103.15%	491'454.37	0.25	a)
FR001400KHF2	3.7500 % ENGIFP 3 3/4 09/06/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	100.49%	957'533.36	0.49	a)
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	0	500	100	400 EUR	103.66%	395'099.75	0.20	a)
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFP 5 1/2 10/09/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	104.24%	993'304.69	0.51	a)
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US05583JAG76	2.3750 % BPCEGP 2 3/8 01/14/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	97.16%	855'577.60	0.44	a)
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	96.83%	852'643.35	0.44	a)
US35177PAX50	5.3750 % ORAFP 5 3/8 01/13/42	1'000	0	0	1'000 USD	98.35%	866'038.67	0.44	a)
USF1R15XK516	4.3750 % BNP 4 3/8 05/12/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	97.21%	1'711'947.70	0.88	a)
USF43628C650	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 08/19/26 REGS	500	0	0	500 USD	95.75%	421'558.91	0.22	a)
XS2451372499	1.2500 % ALDFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	94.66%	1'262'785.83	0.65	a)
FR							15'785'483.54	8.10	
GB00B8429V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	0	350	0	350 GBP	83.31%	324'782.45	0.17	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	110	0	110 GBP	99.45%	121'846.13	0.06	a)
US046353AD01	6.4500 % AZN 6.45 09/15/37	1'000	0	0	1'000 USD	112.61%	991'595.10	0.51	a)
US06738EAP07	5.2000 % BACR 5.2 05/12/26	2'000	0	0	2'000 USD	98.79%	1'739'763.64	0.89	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	2'000	0	0	2'000 USD	122.30%	2'153'742.05	1.10	a)
US11778BAB80	6.5000 % CMCSA 6 1/2 10/15/35 144A	0	500	0	500 USD	109.02%	479'993.86	0.25	a)
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	1'000	0	0	1'000 USD	96.20%	847'071.74	0.43	a)
US404280BX62	4.2920 % HSBC 4.292 09/12/26	0	800	0	800 USD	98.05%	690'734.34	0.35	a)
US404280DA42	2.9990 % HSBC 2.999 03/10/26	500	0	0	500 USD	97.21%	427'977.65	0.22	a)
US53944YAB92	4.6500 % LLOYDS 4.65 03/24/26	2'000	0	0	2'000 USD	97.98%	1'725'497.78	0.88	a)
US780097BK63	4.2690 % NWG 4.269 03/22/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	1'500	0	0	1'500 USD	82.02%	1'083'279.85	0.56	a)
US853254CE80	1.8220 % STANLN 1.822 11/23/25 144A	0	1'000	0	1'000 USD	96.86%	852'909.54	0.44	a)
US853254CG39	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 144A	1'500	0	0	1'500 USD	91.51%	1'208'708.22	0.62	a)
US92857WAB63	6.2500 % VOD 6 1/4 11/30/32	100	0	0	100 USD	106.16%	93'480.57	0.05	a)
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBS89	4.8750 % VOD 4 7/8 06/19/49	500	0	0	500 USD	86.56%	381'099.09	0.20	a)
US92857WBZ23	5.7500 % VOD 5 3/4 02/10/63	700	0	0	700 USD	97.64%	601'832.02	0.31	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	2'000	0	0	2'000 USD	98.84%	1'740'671.24	0.89	a)
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	100	0	0	100 GBP	103.42%	115'199.00	0.06	a)
XS0158715713	5.9000 % VOD 5.9 11/26/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	105.83%	117'873.36	0.06	a)
XS0753789980	4.3750 % CNALN 4 3/8 03/13/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	96.33%	1'072'917.67	0.55	a)
XS1171485722	1.1250 % WELLTR 1 1/8 01/21/27	800	0	300	500 EUR	94.43%	449'918.18	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	100	0	0	100 GBP	91.20%	101'579.94	0.05	a)
XS2525246901	3.2500 % NWISE 3 1/4 09/05/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	98.31%	468'408.88	0.24	a)
XS2659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.29%	113'935.89	0.06	a)
XS2669894821	6.1250 % NWISE 6 1/8 08/21/28 EMTN	600	0	0	600 GBP	103.44%	691'300.93	0.35	a)
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.49%	98'609.14	0.05	a)
GB							18'694'728.26	9.59	
XS1268430201	3.3750 % INDON 3 3/8 07/30/25 REGS	1'000	0	0	1'000 EUR	99.13%	944'593.29	0.48	a)
ID							944'593.29	0.48	
XS1108784510	4.5000 % SRENVX 4 1/2 09/11/44	2'000	0	0	2'000 USD	98.85%	1'740'776.91	0.89	a)
XS1385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	500	0	0	500 USD	99.70%	438'970.17	0.23	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	81.32%	1'002'443.94	0.51	a)
XS2463961677	1.6250 % LIN 1 5/8 03/31/35	0	500	0	500 EUR	82.77%	394'341.26	0.20	a)
IE							3'576'532.28	1.83	
XS0986194883	4.0000 % ISPIM 4 10/30/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.79%	88'417.10	0.05	a)
XS2265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	700	0	0	700 EUR	90.20%	601'657.24	0.31	a)
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	91.89%	1'618'274.79	0.83	a)
IT							2'308'349.13	1.18	
US90351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	97.17%	2'566'950.77	1.32	a)
XS2242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	2'000	0	0	2'000 EUR	96.16%	1'832'509.09	0.94	a)
JE							4'399'459.86	2.26	
US606822BU78	2.0480 % MUFG 2.048 07/17/30	0	1'000	0	1'000 USD	82.96%	730'507.26	0.37	a)
US65535HAP47	2.6480 % NOMURA 2.648 01/16/25	1'000	0	0	1'000 USD	97.44%	857'963.89	0.44	a)
US86562MCE84	1.7100 % SUMIBK 1.71 01/12/31	1'000	0	0	1'000 USD	79.61%	700'981.31	0.36	a)
US86562MCS70	5.7660 % SUMIBK 5.766 01/13/33	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2459747874	1.8500 % EJRAIL 1.85 04/13/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	87.90%	837'584.49	0.43	a)
XS2489982293	3.5560 % MUFG 3.556 06/15/32 EMTN	900	0	0	900 EUR	100.41%	861'085.37	0.44	a)
XS2589713614	4.4160 % MIZUHO 4.416 05/20/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	103.83%	395'755.34	0.20	a)
JP							4'383'877.66	2.25	
XS2058731717	0.2500 % SHNHAN 0 1/4 10/16/24 GMTN	800	0	0	800 EUR	97.39%	742'380.01	0.38	a)
KR							742'380.01	0.38	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88032XAN49	3.9750 % TENCNT 3.975 04/11/29 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	94.77%	834'535.59	0.43	a)
KY							834'535.59	0.43	
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	1'400	0	0	1'400 EUR	57.33%	764'776.58	0.39	a)
XS1637162592	1.2000 % DHR 1.2 06/30/27	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	1'200	0	800	400 EUR	82.85%	315'800.80	0.16	a)
XS2286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	75.91%	1'302'035.10	0.67	a)
XS2318745937	1.2620 % ISDB 1.262 03/31/26	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU							2'382'612.48	1.22	
US02364WAP05	6.1250 % AMXLMM 6 1/8 11/15/37	1'000	0	0	1'000 USD	105.00%	924'591.42	0.47	a)
US05969BAD55	5.3750 % BSMXB 5 3/8 04/17/25 144A	1'000	0	0	1'000 USD	99.62%	877'195.10	0.45	a)
US91086QAZ19	5.7500 % MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN	200	0	0	200 USD	86.46%	152'262.30	0.08	a)
US91087BAS97	4.4000 % MEX 4.4 02/12/52	400	0	0	400 USD	75.47%	265'808.16	0.14	a)
USP60694AF68	2.4310 % KCMA 2.431 07/01/31 REGS	1'150	0	0	1'150 USD	84.31%	853'762.59	0.44	a)
XS1974394675	1.6250 % MEX 1 5/8 04/08/26	100	0	0	100 EUR	95.87%	91'353.88	0.05	a)
XS2363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	0	800	0	800 EUR	77.53%	590'978.27	0.30	a)
MX							3'755'951.72	1.93	
US00084DAW02	2.4700 % ABNAV 2.47 12/13/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	87.00%	766'041.01	0.39	a)
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	700	0	300	400 USD	117.93%	415'361.00	0.21	a)
US29278GAC24	4.7500 % ENELIM 4 3/4 05/25/47 144A	0	600	0	600 USD	83.92%	443'371.11	0.23	a)
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	100	0	0	100 USD	93.22%	82'088.80	0.04	a)
US29278GAV05	4.2500 % ENELIM 4 1/4 06/15/25 144A	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278GAX60	5.0000 % ENELIM 5 06/15/32 144A	2'000	0	0	2'000 USD	95.47%	1'681'330.87	0.86	a)
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	0	500	0	500 USD	103.18%	454'259.70	0.23	a)
US74977RDR21	4.6550 % RABOBK 4.655 08/22/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	97.35%	857'223.55	0.44	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US780641AH94	8.3750 % KPN 8 3/8 10/01/30	1'700	0	400	1'300 USD	116.56%	1'334'295.37	0.68	a)
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0148579666	6.3750 % EOANGR 6 3/8 06/07/32 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	106.76%	1'783'638.61	0.91	a)
XS1261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	2'000	0	0	2'000 USD	99.03%	1'744'049.28	0.89	a)
XS1705553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2084050637	0.3750 % NNGRNV 0 3/8 02/26/25	1'000	0	900	100 EUR	96.58%	92'026.62	0.05	a)
XS2191362859	1.2500 % DLR 1 1/4 02/01/31	1'000	0	0	1'000 EUR	82.27%	783'956.21	0.40	a)
XS2258452478	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/18/29	1'500	0	0	1'500 EUR	86.74%	1'239'825.15	0.64	a)
XS2475954579	1.8750 % PHIANA 1 7/8 05/05/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	94.23%	897'940.12	0.46	a)
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	300	0	300 EUR	103.56%	296'038.95	0.15	a)
NL							12'871'446.35	6.60	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
PE							0.00	0.00	
US83051GAU22	1.4000 % SEB 1.4 11/19/25 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86959LAP85	5.5000 % SHBASS 5 1/2 06/15/28 144A	600	0	0	600 USD	100.59%	531'445.04	0.27	a)
US86960BAX01	3.9000 % SHBASS 3.9 11/20/23 BKNT	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	800	0	600	200 USD	99.82%	175'787.72	0.09	a)
US87020PAV94	5.4720 % SWEDA 5.472 06/15/26 144A	800	0	0	800 USD	100.46%	707'700.45	0.36	a)
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343459074	0.6250 % NDAFH 0 5/8 08/18/31 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	91.51%	1'395'143.24	0.72	a)
XS2442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	90.19%	429'707.52	0.22	a)
XS2443485565	1.3000 % SWEDA 1.3 02/17/27 GMTN	0	700	0	700 EUR	92.61%	617'699.03	0.32	a)
XS2641720987	4.8750 % SBAB 4 7/8 06/26/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.59%	287'560.22	0.15	a)
SE							4'145'043.22	2.13	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	800	0	0	800 USD	96.35%	678'700.34	0.35	a)
XS2080786150	1.2500 % TEMASE 1 1/4 11/20/49 GMTN	620	0	0	620 EUR	62.62%	369'927.62	0.19	a)
SG							1'048'627.96	0.54	
US00206RCQ39	4.7500 % T 4 3/4 05/15/46	500	0	0	500 USD	87.54%	385'433.67	0.20	a)
US00206RKH48	2.2500 % T 2 1/4 02/01/32	0	1'000	0	1'000 USD	80.20%	706'167.37	0.36	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	500	0	0	500 USD	68.13%	299'960.42	0.15	a)
US00287YAR09	4.5000 % ABBV 4 1/2 05/14/35	1'000	0	0	1'000 USD	95.45%	840'483.79	0.43	a)
US02209SBF92	5.9500 % MO 5.95 02/14/49	500	0	0	500 USD	99.53%	438'225.23	0.22	a)
US023135BT22	2.5000 % AMZN 2 1/2 06/03/50	2'000	0	500	1'500 USD	62.73%	828'546.41	0.42	a)
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	1'000	0	0	1'000 USD	82.64%	727'685.45	0.37	a)
US02665WDW82	2.0000 % HNDA 2 03/24/28 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAZ33	2.4000 % AMT 2.4 03/15/25	100	0	0	100 USD	96.73%	85'175.11	0.04	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	100	0	0	100 USD	87.72%	77'241.06	0.04	a)
US031162CR97	3.1500 % AMGN 3.15 02/21/40	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	0	1'000	0	1'000 USD	99.70%	877'933.16	0.45	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	800	0	400	400 USD	100.05%	352'398.82	0.18	a)
US03522AAJ97	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	1'500	0	0	1'500 USD	93.34%	1'232'897.96	0.63	a)
US035240AG57	4.9500 % ABIBB 4.95 01/15/42	100	0	0	100 USD	95.38%	83'989.17	0.04	a)
US036752AC75	3.3500 % ELV 3.35 12/01/24	1'000	0	0	1'000 USD	98.38%	866'293.90	0.44	a)
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	900	0	0	900 USD	83.50%	661'708.92	0.34	a)
US037833DZ01	2.4000 % AAPL 2.4 08/20/50	2'000	0	600	1'400 USD	62.24%	767'219.34	0.39	a)
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05351WAC73	3.2000 % AGR 3.2 04/15/25	0	900	0	900 USD	97.27%	770'890.98	0.40	a)
US05526DBG97	2.7890 % BATSLN 2.789 09/06/24	500	0	0	500 USD	98.50%	433'679.68	0.22	a)
US05565EBE41	3.9500 % BMW 3.95 08/14/28 144A	1'000	0	400	600 USD	96.13%	507'861.21	0.26	a)
US05723KAG58	3.1380 % BHI 3.138 11/07/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	1'800	0	0	1'800 USD	93.45%	1'481'136.34	0.76	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	85.56%	753'368.39	0.39	a)
US06051GJR11	0.9760 % BAC 0.976 04/22/25	0	300	0	300 USD	99.26%	262'210.18	0.13	a)
US07177MAB90	4.0000 % TACHEM 4 06/23/25	1'000	0	0	1'000 USD	98.19%	864'643.40	0.44	a)
US08652BAB53	1.9500 % BBY 1.95 10/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	82.13%	1'446'423.59	0.74	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	500	0	0	500 USD	83.68%	368'422.79	0.19	a)
US110122DX32	3.9000 % BMY 3.9 03/15/62	1'000	0	0	1'000 USD	74.57%	656'597.63	0.34	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	100	0	0	100 USD	74.77%	65'836.76	0.03	a)
US11135FBH38	2.4500 % AVGO 2.45 02/15/31 144A	0	1'000	0	1'000 USD	83.24%	732'932.85	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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US114259AW41	4.8660 % NGGLN 4.866 08/05/32 144A	270	0	0	270 USD	91.77%	218'170.44	0.11	a)
US126408GK35	6.1500 % CSX 6.15 05/01/37	800	0	0	800 USD	108.33%	763'153.28	0.39	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	900	0	0	900 USD	89.34%	708'053.55	0.36	a)
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	500	0	500 USD	99.01%	435'927.23	0.22	a)
US161175CA05	3.9000 % CHTR 3.9 06/01/52	160	0	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	1'800	0	0	1'800 USD	96.88%	1'535'566.32	0.79	a)
US20030NBQ34	4.6000 % CMCSA 4.6 08/15/45	1'650	0	750	900 USD	88.40%	700'572.45	0.36	a)
US254687FY73	3.5000 % DIS 3 1/2 05/13/40	1'500	0	0	1'500 USD	80.28%	1'060'318.49	0.54	a)
US260543BJ10	7.3750 % DOW 7 3/8 11/01/29	2'000	0	300	1'700 USD	110.86%	1'659'458.30	0.85	a)
US30040WAT53	5.4500 % ES 5.45 03/01/28	0	1'000	0	1'000 USD	100.55%	885'367.37	0.45	a)
US30303M8H84	3.8500 % META 3.85 08/15/32	1'000	0	0	1'000 USD	92.62%	815'605.55	0.42	a)
US30303M8Q83	5.6000 % META 5.6 05/15/53	800	0	400	400 USD	103.58%	364'818.12	0.19	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	1'000	0	0	1'000 USD	99.32%	874'600.36	0.45	a)
US37045XDD57	1.2500 % GM 1 1/4 01/08/26	3'000	0	0	3'000 USD	92.67%	2'447'948.90	1.26	a)
US375558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	1'100	0	0	1'100 USD	101.76%	985'647.68	0.51	a)
US38141GZP26	3.0000 % GS 3 03/15/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAC90	3.4000 % HPQ 3.4 06/17/30	0	1'400	0	1'400 USD	90.02%	1'109'748.17	0.57	a)
US44891CBN20	1.8000 % HYNMTR 1.8 10/15/25 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	94.35%	830'754.90	0.43	a)
US458140BV11	2.8000 % INTC 2.8 08/12/41	1'000	0	0	1'000 USD	70.85%	623'907.73	0.32	a)
US458140BY59	3.7500 % INTC 3 3/4 08/05/27	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459506AN18	1.2300 % IFF 1.23 10/01/25 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PAV85	4.2030 % JPM 4.203 07/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	96.07%	845'912.12	0.43	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	2'200	0	0	2'200 USD	81.93%	1'587'186.65	0.81	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	1'000	0	0	1'000 USD	89.24%	785'776.46	0.40	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	2'000	0	800	1'200 USD	99.36%	1'049'925.76	0.54	a)
US571676AC90	3.6000 % MARS 3.6 04/01/34 144A	0	800	0	800 USD	88.39%	622'639.93	0.32	a)
US571903BD44	5.7500 % MAR 5 3/4 05/01/25 EE	500	0	0	500 USD	100.36%	441'849.28	0.23	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	800	0	500	300 USD	80.85%	213'578.04	0.11	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	1'450	0	0	1'450 USD	101.65%	1'297'879.86	0.67	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	2'150	0	500	1'650 USD	69.02%	1'002'847.10	0.51	a)
US595112BV48	6.7500 % MU 6 3/4 11/01/29	1'300	0	0	1'300 USD	106.13%	1'214'871.11	0.62	a)
US609207AY17	1.8750 % MDLZ 1 7/8 10/15/32	200	0	0	200 USD	78.70%	138'592.67	0.07	a)
US615369AE53	5.2500 % MCO 5 1/4 07/15/44	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US615369AP01	4.2500 % MCO 4 1/4 02/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	96.86%	852'933.28	0.44	a)
US61746BEF94	3.6250 % MS 3 5/8 01/20/27	1'264	0	1'264	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61746BEG77	4.3750 % MS 4 3/8 01/22/47	700	0	0	700 USD	86.23%	531'495.96	0.27	a)
US63111XAE13	2.5000 % NDAQ 2 1/2 12/21/40	2'250	0	0	2'250 USD	66.17%	1'311'011.88	0.67	a)
US641062AL84	3.9000 % NESNVX 3.9 09/24/38 144A	1'500	0	0	1'500 USD	87.77%	1'159'252.52	0.59	a)
US641062BG80	4.9500 % NESNVX 4.95 03/14/30 144A	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65339KCH14	4.6250 % NEE 4 5/8 07/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	98.39%	866'350.44	0.44	a)
US65364UAL08	4.2780 % NGGLN 4.278 12/15/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	94.84%	835'101.77	0.43	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	1'000	0	0	1'000 USD	93.18%	820'486.61	0.42	a)
US66989HAR93	2.2000 % NOVNVX 2.2 08/14/30	2'600	0	1'050	1'550 USD	85.90%	1'172'378.22	0.60	a)
US68389XBQ79	4.0000 % ORCL 4 11/15/47	400	0	0	400 USD	76.46%	269'292.40	0.14	a)
US68389XBY04	3.8500 % ORCL 3.85 04/01/60	200	0	0	200 USD	69.47%	122'340.11	0.06	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	100	0	0	100 USD	89.59%	78'888.47	0.04	a)
US693475BM68	5.0680 % PNC 5.068 01/24/34	0	1'000	0	1'000 USD	96.08%	846'006.97	0.43	a)
US70450YAN31	5.2500 % PYPL 5 1/4 06/01/62	500	0	0	500 USD	93.09%	409'840.29	0.21	a)
US717081EZ22	2.5500 % PFE 2.55 05/28/40	1'000	0	0	1'000 USD	70.08%	617'070.09	0.32	a)
US718172BL29	4.2500 % PM 4 1/4 11/10/44	1'200	0	0	1'200 USD	82.45%	871'184.43	0.45	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	2'700	0	0	2'700 USD	82.03%	1'950'281.38	1.00	a)
US74368CBL72	3.2180 % PL 3.218 03/28/25 144A	800	0	0	800 USD	97.69%	688'133.46	0.35	a)
US744573AW69	5.8750 % PEG 5 7/8 10/15/28	0	1'000	0	1'000 USD	102.63%	903'670.13	0.46	a)
US744573AX43	6.1250 % PEG 6 1/8 10/15/33	0	500	0	500 USD	104.36%	459'469.15	0.24	a)
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	800	0	0	800 USD	85.35%	601'234.65	0.31	a)
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US771196BY74	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 144A	1'000	0	0	1'000 USD	63.06%	555'290.75	0.28	a)
US828807DQ71	2.2500 % SPG 2 1/4 01/15/32	1'000	0	0	1'000 USD	80.42%	708'096.77	0.36	a)
US842400FP31	5.5000 % EIX 5 1/2 03/15/40	970	0	0	970 USD	98.78%	843'749.11	0.43	a)
US842400HY20	5.6500 % EIX 5.65 10/01/28	0	800	0	800 USD	102.39%	721'275.53	0.37	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US842434CY66	5.7500 % SRE 5 3/4 06/01/53	500	0	0	500 USD	100.95%	444'474.02	0.23	a)
US845011AC92	2.2000 % SWX 2.2 06/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	83.43%	734'674.42	0.38	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	100	0	0	100 USD	95.86%	84'412.29	0.04	a)
US87264ACX19	5.8000 % TMUS 5.8 09/15/62	1'000	0	0	1'000 USD	101.24%	891'455.39	0.46	a)
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9111312AJ59	6.2000 % UPS 6.2 01/15/38	500	0	0	500 USD	109.36%	481'470.45	0.25	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	0	1'400	1'000	400 USD	107.86%	379'902.31	0.19	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	0	50	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	0	2'800	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	2'800	2'610	190 USD	98.97%	165'575.90	0.08	a)
US92343VCV45	4.2720 % VZ 4.272 01/15/36	100	0	0	100 USD	90.78%	79'932.08	0.04	a)
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	50	0	0	50 USD	68.94%	30'352.73	0.02	a)
US92343VGH15	2.1000 % VZ 2.1 03/22/28	1'000	0	0	1'000 USD	89.04%	784'012.55	0.40	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	800	0	500	300 USD	89.13%	235'452.61	0.12	a)
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	2'000	0	1'500	500 USD	58.13%	255'952.06	0.13	a)
US92928QAF54	3.5000 % URWFP 3 1/2 06/15/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	86.49%	761'599.12	0.39	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	1'200	0	0	1'200 USD	97.56%	1'030'866.93	0.53	a)
USU24652AT35	3.3500 % HOG 3.35 06/08/25 REGS	0	900	0	900 USD	96.63%	765'819.62	0.39	a)
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	101'000	0	0	101'000 JPY	105.21%	625'198.69	0.32	a)
XS0785710046	4.8750 % T 4 7/8 06/01/44	500	0	0	500 GBP	88.34%	491'971.60	0.25	a)
XS1421915049	1.5000 % MMM 1 1/2 06/02/31 MTN	680	0	0	680 EUR	85.46%	553'766.65	0.28	a)
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	92.41%	1'320'867.88	0.68	a)
XS1499602289	1.0000 % BX 1 10/05/26 REGS	1'000	0	0	1'000 EUR	93.05%	886'610.34	0.45	a)
XS1627602201	1.8750 % AIG 1 7/8 06/21/27	1'850	0	668	1'182 EUR	94.12%	1'060'103.76	0.54	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	100	0	0	100 EUR	95.45%	90'953.67	0.05	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	100	0	0	100 EUR	93.79%	89'370.93	0.05	a)
XS2033262622	1.0010 % JPM 1.001 07/25/31 EMTN	900	0	600	300 EUR	84.43%	241'341.54	0.12	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2052321093	1.5000 % VZ 1 1/2 09/19/39	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2058557260	1.5000 % TMO 1 1/2 10/01/39 EMTN	1'000	0	800	200 EUR	74.06%	141'146.80	0.07	a)
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	1'000	0	0	1'000 EUR	91.58%	872'669.66	0.45	a)
XS2091604715	0.3000 % CB 0.3 12/15/24	1'400	0	800	600 EUR	97.13%	555'292.79	0.28	a)
XS2091606330	0.8750 % CB 0 7/8 12/15/29	500	0	0	500 EUR	86.39%	411'607.50	0.21	a)
XS2115092012	1.2000 % IBM 1.2 02/11/40	700	0	500	200 EUR	71.29%	135'864.02	0.07	a)
XS2168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	950	0	310	640 EUR	89.64%	546'653.19	0.28	a)
XS2251337601	1.8750 % VZ 1 7/8 11/03/38	400	0	0	400 GBP	64.64%	287'979.68	0.15	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	500	0	0	500 EUR	77.18%	367'703.40	0.19	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	1'300	0	500	800 EUR	81.45%	620'921.68	0.32	a)
XS2464407860	2.5000 % NESNVX 2 1/2 04/04/32 EMTN	600	0	0	600 GBP	86.26%	576'505.15	0.30	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	101.63%	968'396.32	0.50	a)
XS2621007660	4.1250 % BKNG 4 1/8 05/12/33	500	0	0	500 EUR	103.27%	492'030.86	0.25	a)
XS2625194811	4.6250 % PLD 4 5/8 05/23/33	400	0	0	400 EUR	105.53%	402'242.57	0.21	a)
XS2680745382	4.6680 % NGGLN 4.668 09/12/33 EMTN	0	700	0	700 EUR	104.98%	700'235.88	0.36	a)
XS2726263911	4.1250 % MCD 4 1/8 11/28/35 GMTN	0	200	0	200 EUR	101.91%	194'224.31	0.10	a)
US							80'750'487.12	41.42	
US045167FM03	2.8750 % ASIA 2 7/8 05/06/25 GMTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458182BV36	7.0000 % IADB 7 06/15/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	3'000	0	1'000	2'000 USD	96.77%	1'704'182.55	0.87	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	740	0	0	740 USD	82.79%	539'471.02	0.28	a)
XS1505567088	0.8750 % EIB 0 7/8 09/13/47 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	63.62%	666'836.37	0.34	a)
XS2055744689	0.1500 % EUROF 0.15 10/10/34 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182121827	1.6250 % CAF 1 5/8 06/03/25	1'000	0	0	1'000 EUR	97.10%	925'202.12	0.47	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	700	0	700 EUR	93.14%	621'287.59	0.32	a)
XS							4'456'979.65	2.29	
Derivative Finanzinstrumente							-2'221'663.36	-1.14	
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		265'162	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		1'111'290	1'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		670'831	1'022'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		6'423'601	6'735'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		235'888	38'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		275'576	473'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		15'967'650	18'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		140'000	122'445		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		40'000	38'310		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		50'000	55'502		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		50'000	32'807		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		220'000	193'047		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		200'000	175'798		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		90'000	85'906		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		53'010	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		175'203	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.09.2023		25'000	14'262		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		3'700'000	22'280		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		120'000	105'998		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		16'008'249	18'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		210'519	34'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		253'315	448'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		6'276'454	6'605'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		631'792	972'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		1'056'711	950'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		400'000	354'440		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		80'000	76'052		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		170'000	151'304		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		50'000	47'748		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		133'464	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		12'000'000	72'618		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		100'000	56'915		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		133'306	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		200'000	178'478		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		100'000	89'300		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		40'000	38'339		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		40'000	26'665		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		300'000	271'367		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		50'000	48'257		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		80'000	73'016		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		50'000	48'341		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		90'000	82'701		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		60'000	54'966		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		30'000	29'056		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		20'000	22'367		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		220'000	202'680		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		60'000	57'873		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		15'136'054	16'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		139'500	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		1'030'329	930'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		5'985'745	6'245'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		201'811	348'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		619'554	932'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		200'000	180'768		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		20'000	22'188		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		207'063	230'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		124'204	130'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		235'184	260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		150'000	135'523		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		89'972	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		170'000	152'304		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		89'419	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		150'000	135'293		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		15'209'803	16'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		137'830	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		1'001'687	910'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		6'119'477	6'375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		609'151	932'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		200'046	348'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		220'000	199'669		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		25'000	23'965		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		32'974	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		271'022	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		12'424	19'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		107'467	120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		89'441	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		291'859	330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		163'485	170'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		27'492	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		12'924	20'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		79'440	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		174'901	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		15'315'772	17'690'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		1'058'052	965'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		134'944	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		6'169'935	6'520'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		200'030	348'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		620'433	971'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		86'549	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		75'674	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		121'827	140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		75'405	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		550'000	478'778		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		110'000	103'496		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		130'998	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		233'172	270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		85'537	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'120	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		24'224	22'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		172'894	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		171'050	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		150'492	160'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		30'283	28'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		4'036	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		15'399	24'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		375'962	450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		139'216	150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		320'000	272'700		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		120'000	111'556		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		15'577'824	18'330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		135'413	22'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		1'096'018	1'015'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		6'362'451	6'850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		636'224	1'003'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		201'830	355'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		380'000	329'756		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		190'000	179'033		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		35'000	38'514		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		25'000	16'081		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		100'000	86'785		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		129'341	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		46'828	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		30'000	32'862		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		94'282	110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		134'276	22'900'000		CHF/JPY	-514.74	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		15'729'422	18'110'000		CHF/USD	-198'491.59	-0.10	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		199'773	355'000		CHF/AUD	-3'597.67	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		6'259'135	6'710'000		CHF/EUR	-129'894.81	-0.07	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		627'690	978'000		CHF/CAD	-6'537.16	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		1'033'287	950'000		CHF/GBP	-23'652.10	-0.01	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		450'000	390'929		USD/CHF	4'849.84	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		130'000	121'297		EUR/CHF	2'485.01	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		139'003	160'000		CHF/USD	-1'718.46	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		200'000	174'543		USD/CHF	1'359.42	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		230'000	203'393		USD/CHF	-1'104.68	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		50'000	47'688		EUR/CHF	-79.64	0.00	b)
Klasse A hedged							-356'896.58	-0.18	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		239'582	365'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		396'731	357'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		2'334'814	2'448'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		96'131	165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		85'555	14'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		5'803'278	6'720'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		50'000	43'750		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		15'000	16'671		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		15'000	14'385		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		15'000	9'863		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		80'000	70'214		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		60'000	52'758		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		30'000	28'656		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		44'170	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		61'304	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		1'200'000	7'246		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		80'000	70'675		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		77'211	12'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		5'820'376	6'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		93'297	165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		227'497	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		380'416	342'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		2'283'470	2'403'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		30'000	28'538		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		150'000	132'918		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		60'000	53'420		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'117		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		53'367	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		4'300'000	26'041		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		53'304	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		38'000	21'646		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	26'796		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		80'000	71'446		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		110'000	99'511		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		25'000	24'143		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	27'587		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		10'000	9'186		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'381		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		90'000	82'914		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'291		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		51'780	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		378'895	342'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		2'193'016	2'288'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		5'539'344	6'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		232'665	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		73'650	127'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		70'000	63'286		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		8'000	8'893		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		15'000	10'002		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		85'513	95'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		72'348	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		38'196	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		55'000	49'711		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		35'971	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		70'000	62'731		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		17'823	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		26'805	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		60'000	54'135		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		5'568'765	6'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		51'160	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		367'652	334'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		2'234'689	2'328'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		218'955	335'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		73'005	127'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		80'000	72'623		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		99'365	110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		12'071	11'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		8'491	13'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		53'718	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'758	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		13'180	12'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		114'968	130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		67'301	70'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'799	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		52'950	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		61'197	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'653'589	6'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		50'089	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		391'424	357'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		2'269'249	2'398'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		228'110	357'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		72'999	127'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		51'917	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		37'822	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		39'138	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		28'258	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		110'000	95'767		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		43'646	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		69'071	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		18'985	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		13'199	12'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'764	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		69'141	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		64'127	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		56'416	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		10'796	10'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'756	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		3'455	6'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		55'668	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		150'385	180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		120'000	102'272		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		40'000	37'205		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		40'000	37'237		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		70'000	59'332		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		5'779'007	6'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		50'262	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		409'252	379'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		2'348'070	2'528'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		237'870	375'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		75'615	133'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		130'000	112'819		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		15'000	16'523		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		50'000	47'134		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		12'000	7'734		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		15'000	13'043		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		47'406	55'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		23'399	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		10'000	10'974		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		38'552	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		385'035	354'000		CHF/GBP	-8'813.52	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		5'867'049	6'755'000		CHF/USD	-74'037.03	-0.04	b)
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		49'841	8'500'000		CHF/JPY	-191.05	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		2'334'816	2'503'000		CHF/EUR	-48'454.06	-0.02	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		74'845	133'000		CHF/AUD	-1'347.87	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		232'977	363'000		CHF/CAD	-2'426.37	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		180'000	156'372		USD/CHF	1'939.93	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		55'000	51'335		EUR/CHF	1'033.76	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		60'797	70'000		CHF/USD	-768.62	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		50'000	43'657		USD/CHF	318.87	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		90'000	79'602		USD/CHF	-445.77	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		70'000	61'580		USD/CHF	-13.79	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		30'000	28'625		EUR/CHF	-59.78	0.00	b)
Klasse B hedged							-133'265.30	-0.07	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		65'253	112'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		57'200	9'360'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		3'920'667	4'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		1'571'803	1'648'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		266'710	240'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		160'816	245'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		50'000	43'750		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		10'000	9'600		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		10'000	11'124		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		10'000	6'585		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		60'000	52'668		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		40'000	35'182		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		20'000	19'114		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		35'330	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		43'780	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		800'000	4'841		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		20'000	17'691		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		1'537'517	1'618'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		63'329	112'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		255'835	230'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		152'748	235'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		3'951'123	4'460'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		51'635	8'560'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		100'000	88'622		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		40'000	35'624		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		20'000	19'117		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		35'568	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		35'526	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		2'800'000	16'967		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		26'000	14'820		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	26'811		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		70'000	63'336		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		25'000	22'838		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		15'000	14'523		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		20'000	18'401		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		80'000	73'278		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		30'000	29'056		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		15'000	14'468		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		60'000	55'276		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		3'718'499	4'115'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		254'813	230'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		35'088	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'474'151	1'538'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		156'218	235'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		49'873	86'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		45'000	40'695		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		6'000	6'677		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		9'000	6'013		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		53'997	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		28'639	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		63'301	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		40'000	36'161		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		22'471	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		40'000	35'859		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		22'332	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		40'000	36'100		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		3'745'765	4'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		34'668	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		246'569	224'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'505'151	1'568'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		147'713	226'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		49'437	86'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		50'000	45'400		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		63'221	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		8'771	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'214	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'802	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		26'811	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		75'161	85'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		43'254	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		8'777	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'856	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'290	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		43'704	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		3'805'134	4'395'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		33'942	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		263'142	240'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'526'396	1'613'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		153'351	240'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		49'433	86'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		34'601	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		28'359	30'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		30'434	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		18'829	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		85'000	74'008		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		30'543	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		60'434	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		14'231	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		9'892	9'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		4'476	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		51'849	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		38'464	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		37'601	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		7'548	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		3'827	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		1'712	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		100'247	120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		37'102	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		75'000	63'931		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		25'000	23'265		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		45'000	38'153		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		25'000	23'285		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		3'905'079	4'595'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		34'060	5'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		276'434	256'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		1'586'433	1'708'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		160'483	253'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		50'600	89'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		90'000	78'115		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		35'000	33'003		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		10'000	11'025		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		8'000	5'166		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		10'000	8'706		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		18'713	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		34'469	40'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		7'000	7'691		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		23'977	28'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		3'963'189	4'563'000		CHF/USD	-50'011.98	-0.03	b)
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		33'774	5'760'000		CHF/JPY	-129.47	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		259'953	239'000		CHF/GBP	-5'950.37	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		1'579'242	1'693'000		CHF/EUR	-32'773.76	-0.02	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		157'243	245'000		CHF/CAD	-1'637.63	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		50'084	89'000		CHF/AUD	-901.95	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		100'000	86'886		USD/CHF	1'064.74	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		30'000	28'015		EUR/CHF	550.37	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		43'418	50'000		CHF/USD	-557.52	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		35'000	30'569		USD/CHF	214.11	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		60'000	53'078		USD/CHF	-307.37	0.00	b)
Klasse It hedged							-90'440.83	-0.05	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		5'311'966	4'780'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		3'197'932	4'872'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		1'285'246	2'206'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		31'254'846	32'770'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		77'601'568	89'860'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		1'136'665	186'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	524'744		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.09.2023		150'000	166'448		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.09.2023		130'000	85'250		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		200'000	191'437		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		900'000	789'737		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		600'000	527'393		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.09.2023		210'000	200'419		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		530'293	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		15'000'000	90'232		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		876'015	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		300'000	264'974		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		1'031'484	171'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		3'082'262	4'742'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		78'898'432	89'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		5'150'074	4'630'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		30'750'349	32'360'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		1'247'350	2'206'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		2'000'000	1'772'198		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		180'000	171'084		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		800'000	712'017		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		250'000	238'638		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		622'845	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		55'000'000	332'761		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		490'000	278'796		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		533'235	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		400'000	357'152		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		1'400'000	1'266'380		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		900'000	821'258		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		500'000	483'209		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		500'000	459'376		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		1'200'000	1'105'526		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		400'000	385'820		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		75'147'118	83'160'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		706'638	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		5'129'489	4'630'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		29'741'821	31'030'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'152'278	4'742'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		995'139	1'716'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		900'000	813'458		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		90'000	99'741		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		162'000	107'726		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'080'330	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'266'376	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		668'818	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		800'000	722'771		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		449'922	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		900'000	806'315		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		981'708	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		189'235	200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		357'724	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		2'600'000	2'345'034		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		500'000	478'916		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		74'879'030	82'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		698'177	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		4'997'428	4'540'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		30'170'223	31'430'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		2'993'470	4'580'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		986'434	1'716'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		1'200'000	1'089'102		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		180'000	172'363		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'174'429	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		58'964	90'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		87'980	80'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		806'063	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		447'265	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'547'737	1'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		865'508	900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		187'110	170'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		77'691	120'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		662'116	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		874'506	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		75'808'310	87'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		683'561	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		5'251'885	4'790'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		30'423'834	32'150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		3'060'633	4'790'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		986'355	1'716'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		605'932	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		473'060	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		329'961	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		565'653	650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		1'600'000	1'392'808		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		611'337	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'209'039	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		475'275	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		187'378	170'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		83'662	130'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		950'919	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		855'251	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		752'459	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		151'535	140'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		40'625	70'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		77'116	120'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		2'088'680	2'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		788'899	850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		550'000	511'266		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		1'600'000	1'363'498		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		800'000	677'877		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		550'000	511'705		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		77'855'125	91'610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		685'934	116'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		5'507'087	5'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		3'196'978	5'040'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		31'626'491	34'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		1'015'404	1'786'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		1'700'000	1'475'226		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		650'000	612'481		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		180'000	197'956		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		140'000	89'914		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		300'000	260'316		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		172'419	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		94'017	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		603'611	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		281'093	300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		4'800'000	4'144'032		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		1'800'000	1'678'545		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		210'000	134'787		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		400'000	437'847		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		3'300'000	2'829'965		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		1'400'000	1'304'362		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		170'000	185'653		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		210'000	134'804		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		430'598	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		72'011'398	82'910'000		CHF/USD	-908'721.03	-0.47	b)
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		680'176	116'000'000		CHF/JPY	-2'607.41	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		4'731'365	4'350'000		CHF/GBP	-108'301.73	-0.06	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		2'875'309	4'480'000		CHF/CAD	-29'945.30	-0.02	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		28'543'894	30'600'000		CHF/EUR	-592'366.81	-0.30	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		1'005'055	1'786'000		CHF/AUD	-18'099.87	-0.01	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		2'000'000	1'737'464		USD/CHF	21'554.81	0.01	b)
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		450'000	419'855		EUR/CHF	8'619.97	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		781'910	900'000		CHF/USD	-9'648.40	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		550'000	479'993		USD/CHF	3'738.40	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		1'100'000	972'751		USD/CHF	-5'283.28	0.00	b)
Klasse Nt hedged							-1'641'060.65	-0.84	
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-2'221'663.36	-1.14	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	370'018.62	0.19
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	194'439'551.93	99.72
Derivative Finanzinstrumente	-2'221'663.36	-1.14
Sonstige Vermögenswerte	2'390'473.35	1.23
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	194'978'380.54	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-44'213.57	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	194'934'166.97	

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);	194'439'551.93	99.72
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'221'663.36	-1.14
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	0.57337013
CAD	1 = CHF	0.64920559
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
JPY	100 = CHF	0.58832800
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	5'213'911.37	2.675
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	152'266'618.54	78.112

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2023 - 29.02.2024

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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 - 29.02.2024

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % Max
A	0.900	1.000	-
A hedged	0.950	1.000	-
B	0.900	1.000	-
B hedged	0.950	1.000	-
It	0.330	0.500	-
It hedged	0.380	0.500	-
Nt	0.030	0.200	-
Nt hedged	0.030	0.200	-

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

8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Credit Total Return Index Value unhedged CHF

9 TER

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

10 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.

11 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 all-fällige 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 Beträge

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.