



# BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL STAATSANLEIHEN

Halbjahresbericht per 29.02.2024

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

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://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	20
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
7	Verwaltungskommission	21
8	Benchmark	21
9	TER	21
10	Fussnoten	22
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23

# 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
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		241'183'857.32	260'896'961.29	276'139'609.54	296'113'775.84
<b>Klasse A</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		356'533.70	537'467.68	669'814.29	939'798.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'272.000	7'859.000	8'474.000	10'034.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		67.63	68.39	79.04	93.66
Ausschüttung je Anteil		-	1.10	1.65	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
<b>Klasse A hedged</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'691'118.54	1'666'802.93	1'945'353.48	2'284'009.12
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'155.133	22'476.683	24'382.783	25'048.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.03	74.16	79.78	91.19
Ausschüttung je Anteil		-	1.15	1.45	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
<b>Klasse B</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		94'756.69	94'816.19	107'940.11	100'750.52
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000	1'271.000	1'011.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.55	74.60	84.93	99.65
Thesaurierung je Anteil		-	1.22	1.57	1.55
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
<b>Klasse B hedged</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'274'623.13	1'281'189.59	1'392'814.63	1'866'746.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'000.000	16'000.000	16'358.000	19'370.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.66	80.07	85.15	96.37
Thesaurierung je Anteil		-	1.20	1.50	1.46
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
<b>Klasse It</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		77.08	77.30	87.80	102.46
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1.000	1.000	1.000	1.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.08	77.30	87.80	102.46
Thesaurierung je Anteil		-	1.65	2.45	2.53
Total Expense Ratio (TER)		0.23 %	0.22 %	0.23 %	0.22 %
<b>Klasse It hedged</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'373'628.12	5'499'606.44	5'815'524.49	5'786'196.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		65'055.000	66'380.000	66'380.000	58'680.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.60	82.85	87.61	98.61
Thesaurierung je Anteil		-	1.72	2.07	2.05
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %

Klasse Nt	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	58'846'041.86	71'339'480.42	80'786'090.22	90'787'253.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	735'094.990	891'465.961	890'922.741	857'492.070
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	80.05	80.02	90.68	105.88
Thesaurierung je Anteil	-	1.95	2.43	2.46
Total Expense Ratio (TER)	0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

Klasse Nt hedged	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	173'547'078.20	180'477'520.74	185'421'984.52	194'348'917.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	2'071'108.976	2'149'529.356	2'093'419.820	1'954'543.301
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	83.79	83.96	88.57	99.43
Thesaurierung je Anteil	-	1.95	2.33	2.32
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	0.51 %	-6.48 %	-16.36 %	-4.16 %
Klasse A hedged	0.03 %	0.52 %	-13.62 %	-3.48 %
Klasse B	0.51 %	-6.47 %	-16.36 %	-4.15 %
Klasse B hedged	0.02 %	0.48 %	-13.66 %	-3.53 %
Klasse It	0.47 %	-6.25 %	-15.69 %	-3.28 %
Klasse It hedged	0.43 %	1.25 %	-12.92 %	-2.94 %
Klasse Nt	0.90 %	-5.74 %	-15.72 %	-3.41 %
Klasse Nt hedged	0.62 %	1.60 %	-12.64 %	-2.64 %
Benchmark Hedge	0.74 %	-	-	-
Benchmark	1.08 %	-5.23 %	-16.20 %	-3.73 %
Tracking Error 33)	-	-	0.56 %	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	-0.57 %
Klasse A hedged	-0.71 %
Klasse B	-0.57 %
Klasse B hedged	-0.72 %
Klasse It	-0.61 %
Klasse It hedged	-0.31 %
Klasse Nt	-0.18 %
Klasse Nt hedged	-0.12 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'447'987.17	2'012'493.34
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	240'689'797.49	258'556'158.21
Derivative Finanzinstrumente	-2'470'062.89	-1'211'390.72
Sonstige Vermögenswerte	1'525'086.03	1'549'941.87
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>241'192'807.80</b>	<b>260'907'202.70</b>
Andere Verbindlichkeiten	-8'950.48	-10'241.41
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>241'183'857.32</b>	<b>260'896'961.29</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
<b>Klasse A</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'859.000	8'474.000
Zurückgenommene Anteile		-2'587.000	-615.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>5'272.000</b>	<b>7'859.000</b>
<b>Klasse A hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'476.683	24'382.783
Ausgegebene Anteile		700.000	-
Zurückgenommene Anteile		-21.550	-1'906.100
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>23'155.133</b>	<b>22'476.683</b>
<b>Klasse B</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'271.000</b>	<b>1'271.000</b>
<b>Klasse B hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'000.000	16'358.000
Zurückgenommene Anteile		-	-358.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>16'000.000</b>	<b>16'000.000</b>
<b>Klasse It</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1.000	1.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1.000</b>	<b>1.000</b>
<b>Klasse It hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		66'380.000	66'380.000
Zurückgenommene Anteile		-1'325.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>65'055.000</b>	<b>66'380.000</b>
<b>Klasse Nt</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		891'465.961	890'922.741
Ausgegebene Anteile		15'818.542	45'111.898
Zurückgenommene Anteile		-172'189.513	-44'568.678
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>735'094.990</b>	<b>891'465.961</b>
<b>Klasse Nt hedged</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'149'529.356	2'093'419.820
Ausgegebene Anteile		156'083.576	318'726.198
Zurückgenommene Anteile		-234'503.956	-262'616.662
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'071'108.976</b>	<b>2'149'529.356</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.09.2023 29.02.2024</b>	<b>01.09.2022 31.08.2023</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		260'896'961.29	276'139'609.54
Ausbezahlte Ausschüttung		-31'622.60	-49'315.46
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'110'745.39	-2'556'601.67
Saldo aus dem Anteilverkehr		-18'944'228.25	4'757'906.78
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'373'492.27	-17'394'637.90
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>241'183'857.32</b>	<b>260'896'961.29</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.09.2023 29.02.2024</b>	<b>01.09.2022 31.08.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		16'098.66	18'511.45
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-656.43	-5'449.57
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'458'556.65	6'212'810.59
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		78'498.13	316'875.82
<b>Total Ertrag</b>		<b>2'552'497.01</b>	<b>6'542'748.29</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-597.52	-1'659.35
Reglementarische Vergütungen		-58'404.64	-125'387.86
Sonstige Aufwendungen		-19.35	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-218'736.27	-288'727.13
<b>Total Aufwand</b>		<b>-277'757.78</b>	<b>-415'774.34</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>2'274'739.23</b>	<b>6'126'973.95</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-21'007'518.51	-26'902'824.84
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		47'218.73	70'285.13
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-18'685'560.55</b>	<b>-20'705'565.76</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		20'059'052.82	3'310'927.86
<b>Gesamterfolg</b>		<b>1'373'492.27</b>	<b>-17'394'637.90</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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>240'689'797.49</b>	<b>99.79</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>240'689'797.49</b>	<b>99.79</b>	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	0	1'500	0	1'500 AUD	92.34%	794'200.77	0.33	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	2'800	0	2'550	250 AUD	79.76%	114'331.44	0.05	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	500	0	0	500 AUD	56.92%	163'181.14	0.07	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	2'500	0	2'500 AUD	80.01%	1'146'940.94	0.48	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	2'200	0	750	1'450 AUD	102.83%	854'914.93	0.35	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	500	0	300	200 AUD	101.01%	115'832.23	0.05	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	800	0	0	800 AUD	87.03%	399'203.22	0.17	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	3'000	0	2'300	700 AUD	87.60%	351'594.58	0.15	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	1'000	0	600	400 AUD	78.40%	179'808.87	0.07	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	1'180	80	1'180	80 AUD	99.79%	45'771.59	0.02	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	2'100	1'500	800	2'800 AUD	97.46%	1'564'578.01	0.65	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	500	1'820	300	2'020 AUD	99.19%	1'148'814.60	0.48	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	770	0	0	770 AUD	94.77%	418'395.98	0.17	a)
<b>AU</b>							<b>7'297'568.30</b>	<b>3.03</b>	
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	850	340	0	1'190 CAD	99.40%	767'919.32	0.32	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	150	0	0	150 CAD	87.56%	85'266.66	0.04	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	0	0	100 CAD	97.37%	63'209.90	0.03	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	230	0	0	230 CAD	75.21%	112'307.50	0.05	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	1'500	0	320	1'180 CAD	99.66%	763'473.30	0.32	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	50	0	0	50 CAD	69.90%	22'688.76	0.01	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	2'000	0	400	1'600 CAD	89.27%	927'262.94	0.38	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	190	0	190	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	100	0	0	100 CAD	110.31%	71'612.57	0.03	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	500	0	0	500 CAD	117.28%	380'690.91	0.16	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	500	0	0	500 CAD	115.79%	375'841.35	0.16	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	1'300	0	200	1'100 CAD	106.76%	762'415.36	0.32	a)
<b>CA</b>							<b>4'332'688.57</b>	<b>1.80</b>	
CND100010KS7	3.6100 % CGB 3.61 06/07/25 1813	25'000	0	3'300	21'700 CNY	102.46%	2'717'168.11	1.13	a)
CND10001Q6Q0	4.0800 % CGB 4.08 10/22/48 1824	28'000	0	0	28'000 CNY	127.34%	4'357'236.49	1.81	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	30'000	0	0	30'000 CNY	104.86%	3'844'389.46	1.59	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	6'500	0	3'000	3'500 CNY	115.17%	492'599.85	0.20	a)
CND100031JZ0	1.9900 % CGB 1.99 04/09/25 INBK	15'000	0	0	15'000 CNY	100.05%	1'833'985.75	0.76	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	34'200	0	0	34'200 CNY	101.89%	4'258'420.75	1.77	a)
CND100036VL4	3.7300 % CGB 3.73 05/25/70 INBK	8'900	0	0	8'900 CNY	129.03%	1'403'387.92	0.58	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	8'000	0	0	8'000 CNY	103.16%	1'008'544.16	0.42	a)
CND10004GNL8	2.6900 % CGB 2.69 08/12/26 INBK	10'000	0	0	10'000 CNY	101.38%	1'238'936.69	0.51	a)
CND100058NN1	2.1800 % CGB 2.18 06/25/24 INBK	5'000	0	0	5'000 CNY	100.19%	612'196.27	0.25	a)
CND10005J69	2.6900 % CGB 2.69 08/15/32 INBK	4'000	0	0	4'000 CNY	102.24%	499'805.08	0.21	a)
CND10005L4G7	2.6000 % CGB 2.6 09/01/32 INBK	4'000	0	0	4'000 CNY	101.56%	496'484.89	0.21	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	4'000	0	3'000	1'000 CNY	103.96%	127'050.10	0.05	a)
<b>CN</b>							<b>22'890'205.52</b>	<b>9.49</b>	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	0	700	400	300 EUR	98.89%	282'691.91	0.12	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	1'000	0	500	500 EUR	95.53%	455'144.75	0.19	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	0	400	0	400 EUR	84.23%	321'026.41	0.13	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	800	1'200	1'300	700 EUR	84.87%	566'111.83	0.23	a)
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	5'100	10'200	11'010	4'290 EUR	99.02%	4'047'604.18	1.68	a)
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	500	0	0	500 EUR	116.28%	553'982.58	0.23	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	400	0	100	300 EUR	121.16%	346'351.19	0.14	a)
<b>DE</b>							<b>6'572'912.85</b>	<b>2.73</b>	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	3'000	0	2'500	500 EUR	101.84%	485'203.45	0.20	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.
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	2'200	350	0	2'550 EUR	109.48%	2'660'081.15	1.10	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	2'400	3'000	3'500	1'900 EUR	99.38%	1'799'325.87	0.75	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	1'000	100	0	100 EUR	93.95%	89'522.44	0.04	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	1'300	300	1'150	450 EUR	87.22%	374'014.35	0.16	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	300	250	0	550 EUR	90.37%	473'616.39	0.20	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	0	1'300	0	1'300 EUR	95.69%	1'185'321.18	0.49	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	0	100	0	100 EUR	86.18%	82'114.73	0.03	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	0	500	0	500 EUR	89.41%	425'967.46	0.18	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	2'500	600	1'900	1'200 EUR	69.62%	796'054.02	0.33	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	1'100	700	650	1'150 EUR	48.46%	531'021.42	0.22	a)
ES0000012J24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	0	1'000	0	1'000 EUR	71.79%	684'046.39	0.28	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	0	3'950	1'400	2'550 EUR	91.73%	2'229'001.00	0.92	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	1'600	100	500	1'200 EUR	82.81%	946'876.40	0.39	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	2'300	800	2'050	1'050 EUR	66.86%	668'932.71	0.28	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	300	100	0	400 EUR	95.49%	363'970.96	0.15	a)
<b>ES</b>							<b>13'795'069.92</b>	<b>5.72</b>	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	3'100	1'000	0	4'100 EUR	112.99%	4'414'318.02	1.83	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	400	0	300	100 EUR	112.73%	107'418.54	0.04	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	2'000	0	0	2'000 EUR	100.04%	1'906'529.07	0.79	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	0	300	0	300 EUR	82.05%	234'552.24	0.10	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	5'000	2'300	0	7'300 EUR	93.28%	6'488'602.20	2.69	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	2'500	0	1'300	1'200 EUR	83.70%	957'076.07	0.40	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	500	700	500	700 EUR	66.52%	443'700.62	0.18	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	0	2'190	0	2'190 EUR	83.44%	1'741'238.10	0.72	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	0	400	0	400 EUR	59.94%	228'463.32	0.09	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	0	1'700	0	1'700 EUR	52.90%	856'928.02	0.36	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	3'000	0	0	3'000 EUR	93.75%	2'679'984.51	1.11	a)
<b>FR</b>							<b>20'058'810.71</b>	<b>8.32</b>	
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	900	2'400	900	2'400 GBP	101.83%	2'722'164.50	1.13	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	1'050	0	0	1'050 GBP	100.21%	1'172'000.35	0.49	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'300	100	800	600 GBP	104.13%	695'912.28	0.29	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	1'300	0	300	700 GBP	100.46%	783'282.81	0.32	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	2'190	0	1'200	990 GBP	103.01%	1'135'904.87	0.47	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	1'800	250	0	2'050 GBP	83.31%	1'902'297.23	0.79	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	900	0	900 GBP	99.45%	996'922.91	0.41	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	2'100	0	1'700	400 GBP	58.79%	261'933.37	0.11	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	1'800	300	500	1'600 GBP	95.98%	1'710'519.81	0.71	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	440	0	440 GBP	64.52%	316'209.14	0.13	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	0	820	820	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BYMZK75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	3'000	0	100	2'900 GBP	63.94%	2'065'306.09	0.86	a)
<b>GB</b>							<b>13'762'453.36</b>	<b>5.71</b>	
X52309433899	1.7500 % CROATI 1 3/4 03/04/41	400	0	0	400 EUR	74.90%	285'483.86	0.12	a)
<b>HR</b>							<b>285'483.86</b>	<b>0.12</b>	
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	2'000	0	0	2'000 EUR	86.51%	1'648'678.82	0.68	a)
<b>IE</b>							<b>1'648'678.82</b>	<b>0.68</b>	
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	500	0	0	500 EUR	109.36%	521'046.16	0.22	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	2'000	1'700	1'500	2'200 EUR	97.94%	2'053'137.80	0.85	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	4'000	1'500	0	5'500 EUR	88.70%	4'648'379.53	1.93	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	3'900	0	3'000	900 EUR	97.13%	832'990.64	0.35	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	500	7'800	5'600	2'700 EUR	94.82%	2'439'540.58	1.01	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	500	400	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	4'600	1'700	1'700	4'600 EUR	81.22%	3'560'086.65	1.48	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	0	500	200	300 EUR	93.81%	268'161.39	0.11	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>IT</b>							<b>14'323'342.75</b>	<b>5.94</b>	
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	0	95'000	0	95'000 JPY	99.61%	556'715.08	0.23	a)
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	1'720'000	0	1'720'000	0 JPY	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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	300'000	450'000	0	750'000 JPY	99.13%	4'373'850.98	1.81	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	500'000	0	0	500'000 JPY	98.32%	2'892'191.03	1.20	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	50'000	0	50'000 JPY	101.06%	297'267.43	0.12	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	0	2'070'000	170'000	1'900'000 JPY	101.20%	11'311'923.65	4.69	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	1'290'000	0	1'200'000	90'000 JPY	103.32%	547'079.74	0.23	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	1'180'000	0	800'000	380'000 JPY	105.78%	2'364'866.76	0.98	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	1'100'000	0	340'000	760'000 JPY	111.11%	4'967'919.29	2.06	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	100'000	580'000	0	680'000 JPY	106.37%	4'255'470.56	1.76	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	80'000	0	0	80'000 JPY	94.91%	446'682.15	0.19	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	50'000	0	0	50'000 JPY	87.23%	256'599.26	0.11	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	380'000	0	0	380'000 JPY	117.34%	2'623'307.49	1.09	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	630'000	0	0	630'000 JPY	111.01%	4'114'474.22	1.71	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	440'000	0	45'000	395'000 JPY	103.99%	2'416'572.56	1.00	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	625'000	0	0	625'000 JPY	111.13%	4'086'379.21	1.69	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	200'000	0	0	200'000 JPY	104.13%	1'225'228.36	0.51	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	40'000	0	0	40'000 JPY	67.17%	158'064.91	0.07	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	65'000	0	0	65'000 JPY	77.71%	297'161.83	0.12	a)
<b>JP</b>							<b>47'191'754.51</b>	<b>19.57</b>	
XS1310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.84%	248'256.61	0.10	a)
XS2013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	250	0	0	250 EUR	65.55%	156'149.00	0.06	a)
XS2168038417	0.2500 % LITHUN 0 1/4 05/06/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.18%	274'947.83	0.11	a)
<b>LT</b>							<b>679'353.44</b>	<b>0.28</b>	
XS1409726731	1.3750 % LATVIA 1 3/8 05/16/36 GMTN	500	0	0	500 EUR	77.31%	368'332.31	0.15	a)
XS2361416915	0.0000 % LATVIA 0 01/24/29 GMTN	500	0	0	500 EUR	86.13%	410'340.17	0.17	a)
<b>LV</b>							<b>778'672.48</b>	<b>0.32</b>	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	400	0	200	200 NZD	97.25%	104'344.56	0.04	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	530	0	200	330 NZD	99.58%	176'285.12	0.07	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	200	0	0	200 NZD	92.86%	99'636.52	0.04	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	280	0	0	280 NZD	79.49%	119'408.66	0.05	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	600	0	400	200 NZD	99.02%	106'240.31	0.04	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	260	0	0	260 NZD	95.89%	133'748.47	0.06	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	300	0	0	300 NZD	63.01%	101'413.78	0.04	a)
<b>NZ</b>							<b>841'077.42</b>	<b>0.35</b>	
PTOTEBOE0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37	350	0	0	350 EUR	108.88%	363'111.46	0.15	a)
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45	320	0	0	320 EUR	109.03%	332'454.15	0.14	a)
PTOTEBOE0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	400	0	0	400 EUR	55.58%	211'852.66	0.09	a)
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	350	0	0	350 EUR	78.31%	261'181.05	0.11	a)
PTOTEZOE0014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38	320	0	0	320 EUR	101.83%	310'496.67	0.13	a)
<b>PT</b>							<b>1'479'095.99</b>	<b>0.61</b>	
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	600	0	0	600 EUR	83.33%	476'428.35	0.20	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	600	0	0	600 EUR	79.28%	453'279.00	0.19	a)
<b>SI</b>							<b>929'707.35</b>	<b>0.39</b>	
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	1'000	0	0	1'000 EUR	66.94%	637'812.49	0.26	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	900	0	0	900 EUR	85.83%	736'048.10	0.31	a)
<b>SK</b>							<b>1'373'860.59</b>	<b>0.57</b>	
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	140	800	0	940 USD	107.86%	892'770.42	0.37	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	140	800	0	940 USD	101.11%	836'899.53	0.35	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	4'000	1'000	2'400	2'600 USD	77.48%	1'773'950.64	0.74	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	1'000	700	800	900 USD	77.20%	611'830.87	0.25	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	5'700	500	4'000	2'200 USD	67.91%	1'315'486.67	0.55	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	500	0	0	500 USD	62.25%	274'071.19	0.11	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	8'400	200	2'000	6'600 USD	50.78%	2'951'218.36	1.22	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	0	3'600	1'000	2'600 USD	61.08%	1'398'340.80	0.58	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	2'500	300	1'000	1'800 USD	61.69%	977'740.71	0.41	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	5'980	700	5'000	1'680 USD	63.45%	938'677.24	0.39	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	5'500	700	3'500	2'700 USD	66.58%	1'582'884.82	0.66	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	5'200	900	2'000	4'100 USD	59.61%	2'152'050.62	0.89	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	500	0	0	500 USD	87.45%	385'034.22	0.16	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	7'000	0	7'000	0 USD	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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	6'100	13'000	8'500	10'600 USD	90.84%	8'479'201.19	3.52	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	19'500	0	18'000	1'500 USD	96.20%	1'270'674.86	0.53	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	9'900	0	3'700	6'200 USD	79.61%	4'346'202.45	1.80	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	11'800	6'000	2'000	15'800 USD	93.45%	13'001'842.88	5.39	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	0	4'000	0	4'000 USD	92.77%	3'267'390.67	1.35	a)
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	0	4'000	800	3'200 USD	92.16%	2'596'741.95	1.08	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	5'340	12'050	8'600	8'790 USD	98.97%	7'660'064.23	3.18	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	23'100	1'950	3'000	22'050 USD	86.84%	16'861'693.23	6.99	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	0	15'000	3'000	12'000 USD	83.98%	8'874'293.50	3.68	a)
<b>US</b>							<b>82'449'061.05</b>	<b>34.18</b>	

## Derivative Finanzinstrumente

**-2'470'062.89 -1.02**

### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CAD/CHF	Verfall 07.09.2023	32'491	49'500	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023	54'300	93'200	CHF/AUD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023	367'888	60'200'000	CHF/JPY	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023	8'492	15'800	CHF/NZD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023	97'794	88'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 07.09.2023	155'597	1'283'000	CHF/CNY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	539'739	625'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023	397'720	417'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	13'086	15'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023	4'755	5'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023	700'000	4'322	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall 07.09.2023	45'000	5'506	CNY/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 07.09.2023	5'000	5'577	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	10'000	8'818	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	6'980	8'000	CHF/USD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023	32'175	49'500	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023	52'699	93'200	CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023	401'009	422'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023	358'908	59'500'000	CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	565'205	638'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023	92'323	83'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 12.10.2023	150'322	1'238'000	CHF/CNY	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 12.10.2023	8'226	15'800	CHF/NZD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	12'000	10'708	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	7'000	6'711	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023	800'000	4'878	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	5'000	4'509	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	6'000	5'780	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023	1'000'000	6'116	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 12.10.2023	4'000	2'693	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023	6'000	3'513	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall 12.10.2023	26'000	3'215	CNY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	12'000	10'978	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023	900'000	5'559	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	5'000	4'861	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall 12.10.2023	20'000	2'526	CNY/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 12.10.2023	3'000	3'361	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	4'000	3'900	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	6'000	5'528	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2023	544'898	603'000	CHF/USD	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 02.11.2023	8'605	15'800	CHF/NZD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023	346'009	56'800'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023	88'630	80'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	383'394	400'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023	147'804	1'192'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023	30'246	45'500	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023	50'569	87'200	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 02.11.2023	1'500'000	9'168	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 02.11.2023	10'000	5'829	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/NZD	Verfall 02.11.2023	4'700	2'590	NZD/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	7'629	8'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2023	8'975	10'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	5'704	6'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2023	7'208	8'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023	7'240	1'200'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023	3'315	27'000	CHF/CNY	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 02.11.2023		7'000	6'318	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		1'319	11'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		12'000	6'926	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		4'479	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		5'856	11'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		340'061	56'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		88'060	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		561'411	619'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		397'406	414'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		152'284	1'230'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		29'739	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		37'480	65'200	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		4'000	3'660	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		500'000	3'049	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		4'000	2'342	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		8'928	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		11'470	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		8'786	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		9'589	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		5'474	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		2'281	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		2'411	20'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		6'000	3'485	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		9'000	7'998	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		5'268	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		5'883	1'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'700	14'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		549'775	635'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		5'937	11'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		344'727	58'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		93'196	85'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		401'235	424'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		153'677	1'264'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		29'073	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		34'028	59'200	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		8'628	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		7'540	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'933	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		500'000	3'003	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		28'000	3'437	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		17'000	14'826	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		5'000	4'733	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'016	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		4'380	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		7'538	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'165	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		4'193	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		5'601	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		3'521	30'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		12'505	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		10'659	1'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		9'253	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		6'373	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		1'871	3'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		2'550	4'500	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		2'321	20'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		714	1'400	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		8'000	7'465	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		3'000	3'258	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		500'000	2'999	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		8'000	6'846	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		8'442	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		15'000	8'590	AUD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		6'623	12'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		570'252	671'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		350'654	59'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		99'344	92'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		411'469	443'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		152'360	1'286'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		30'765	48'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		27'688	48'700	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		15'000	13'044	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		12'000	11'335	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		1'200'000	7'073	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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		5'500	6'077	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		3'000	1'956	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		9'000	1'112	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		2'200	1'195	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		4'000	3'483	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		9'293	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		2'900'000	16'999	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		22'737	40'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		2'493	21'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		566'294	652'000	CHF/USD		-7'146.14	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		5'409	10'300	CHF/NZD		-110.38	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		323'670	55'200'000	CHF/JPY		-1'240.77	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		94'083	86'500	CHF/GBP		-2'153.58	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		156'393	1'298'000	CHF/CNY		-2'197.28	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		411'368	441'000	CHF/EUR		-8'537.04	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		29'202	45'500	CHF/CAD		-304.12	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		49'915	88'700	CHF/AUD		-898.92	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		20'000	17'401	USD/CHF		188.96	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		6'910	8'000	CHF/USD		-125.80	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		13'000	11'524	USD/CHF		-90.13	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		19'297	22'000	CHF/USD		-51.94	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		11'325	12'000	CHF/EUR		-101.38	0.00	b)
							<b>-22'768.52</b>	<b>-0.01</b>	
<b>Klasse A hedged</b>									
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		41'307	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.09.2023		116'910	964'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		6'503	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		414'520	480'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		71'678	64'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		24'615	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		306'158	321'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		281'416	46'050'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		500'000	3'095	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.09.2023		15'000	1'855	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		8'714	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		8'000	7'060	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		6'980	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		274'761	45'550'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		305'033	321'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.10.2023		115'230	949'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		71'745	64'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		40'089	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.10.2023		6'300	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		24'375	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		434'092	490'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		8'000	7'149	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		1'300'000	7'941	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		5'000	4'509	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		7'000	6'739	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		17'000	2'113	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		4'000	2'352	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		3'000	2'028	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		2'000	2'244	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		8'000	7'329	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		4'000	3'895	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		500'000	3'102	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		15'000	1'902	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		5'000	4'606	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		419'291	464'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		6'590	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		266'512	43'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		69'243	62'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		297'131	310'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		113'705	917'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		22'934	34'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		38'797	66'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		1'200'000	7'340	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		2'000	2'246	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		3'500	1'936	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		7'500	4'380	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		6'273	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		6'303	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		7'615	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		6'028	1'000'000	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.
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		2'572	21'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		1'073	9'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		7'000	6'318		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		9'500	5'489		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		4'479	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		431'715	476'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		4'537	8'600		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		262'117	43'550'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		66'596	60'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		305'254	318'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		117'246	947'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		22'549	34'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		28'685	49'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		4'000	3'660		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		400'000	2'445		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		3'000	1'764		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		7'136	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		8'816	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		7'665	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		6'435	1'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		5'474	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		1'703	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'679	14'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		4'000	2'334		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		5'000	4'457		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		4'109	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		3'502	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'329	11'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		423'370	489'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		4'600	8'600		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		264'880	44'950'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		71'816	65'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		308'497	326'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		118'176	972'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		22'044	34'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		26'383	45'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'896	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		6'594	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'192	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		9'000	7'863		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		11'000	1'369		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'153	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		4'380	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		5'646	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		4'299	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		3'349	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		4'663	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		2'811	24'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		9'162	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		6'468	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		8'877	1'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		4'772	4'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		2'188	3'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		2'092	3'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		1'733	15'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		554	1'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		7'000	6'536		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		6'000	5'142		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		400'000	2'405		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		3'000	3'258		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'747	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		12'000	6'878		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		443'624	522'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		5'139	9'700		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		76'667	71'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		272'304	46'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		118'476	1'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		319'516	344'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		24'104	38'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		21'377	37'600		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		12'000	10'441		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		9'000	8'509		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		900'000	5'312		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		4'000	4'428		GBP/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/CAD Verfall 07.02.2024		2'700	1'763	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		7'000	872	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		1'700	930	NZD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		6'496	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		5'000	4'346	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		17'614	31'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		1'893	16'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		2'300'000	13'488	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		438'617	505'000	CHF/USD		-5'534.96	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		251'255	42'850'000	CHF/JPY		-963.17	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		4'201	8'000	CHF/NZD		-85.73	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		319'020	342'000	CHF/EUR		-6'620.57	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		72'874	67'000	CHF/GBP		-1'668.10	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		121'572	1'009'000	CHF/CNY		-1'708.05	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		22'656	35'300	CHF/CAD		-235.96	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		38'604	68'600	CHF/AUD		-695.22	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		15'000	13'058	USD/CHF		134.23	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		6'910	8'000	CHF/USD		-125.80	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		11'000	9'756	USD/CHF		-80.88	0.00	b)
<b>Klasse B hedged</b>							<b>-17'584.21</b>	<b>-0.01</b>	
	CNY/CHF Verfall 07.09.2023		501'355	4'134'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		105'285	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		293'936	264'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		1'204'498	197'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		1'787'617	2'070'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		1'311'426	1'375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		27'142	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		172'395	295'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		1'400'000	8'613	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		26'201	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		11'064	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.09.2023		50'000	6'114	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		25'000	22'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		21'875	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		305'334	274'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		104'259	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.10.2023		26'293	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		1'306'605	1'375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.10.2023		495'892	4'084'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		1'860'394	2'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		167'312	295'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		1'180'476	195'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	26'725	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		5'000'000	30'459	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		25'000	23'990	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		20'000	17'946	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		5'000	5'564	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		10'000	6'689	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		8'000	4'673	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		80'000	9'831	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		35'000	31'962	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		15'000	14'523	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		2'500'000	15'389	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		60'000	7'518	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		5'000	5'582	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		45'000	41'232	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		35'000	33'894	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		4'000'000	24'584	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		7'000	4'780	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		7'000	7'848	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		60'000	7'564	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		13'000	7'665	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 12.10.2023		4'000	2'212	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		20'000	18'425	USD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		25'324	46'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'762'108	1'950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		1'122'093	184'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		285'279	257'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'246'032	1'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		481'604	3'884'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		95'326	143'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		159'419	274'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		5'100'000	31'099	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 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		25'000	14'528	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		10'300	5'640	NZD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		31'486	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		27'112	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		38'196	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		24'204	4'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		8'270	67'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		25'000	22'486	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		4'261	35'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		39'000	22'442	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		13'496	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'818'465	2'005'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		1'102'037	183'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		19'099	36'200	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		283'444	257'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'286'290	1'340'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		493'499	3'986'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		93'726	143'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		121'235	210'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		10'000	9'104	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		1'400'000	8'484	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		10'000	5'809	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		26'844	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		29'358	5'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		39'777	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		33'635	35'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		19'786	18'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		5'746	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		7'904	65'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'856	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		25'000	22'163	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		18'000	10'396	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		13'215	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		17'708	3'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		5'901	48'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'783'521	2'060'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		19'362	36'200	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		1'117'858	189'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		302'066	275'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'301'175	1'375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		498'356	4'099'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		95'461	149'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		110'879	192'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		25'944	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		23'628	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		26'082	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		40'000	34'843	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		55'000	6'723	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		17'245	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		18'712	17'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		21'615	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		22'674	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		23'433	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		16'863	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		11'808	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		41'752	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		27'819	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		36'786	6'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		6'941	11'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		20'245	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		9'145	16'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		7'609	65'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		2'520	4'800	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		30'000	25'590	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		30'000	27'912	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		1'800'000	10'719	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		8'000	8'639	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		29'621	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		45'000	25'710	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		1'869'679	2'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		21'722	41'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		1'147'756	194'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		327'726	303'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		1'345'867	1'449'000	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.
CNY/CHF	Verfall 07.02.2024		498'665	4'209'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.02.2024		101'745	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 07.02.2024		93'183	163'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.02.2024		50'000	43'411	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 07.02.2024		40'000	37'714	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.02.2024		3'700'000	21'745	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 07.02.2024		20'000	22'021	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 07.02.2024		12'000	7'734	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 07.02.2024		30'000	3'638	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 07.02.2024		7'500	4'003	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 07.02.2024		5'000	2'875	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.02.2024		15'000	12'978	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.02.2024		35'398	38'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.02.2024		9'700'000	56'788	JPY/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 07.02.2024		73'962	130'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.02.2024		8'741	73'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.03.2024		1'854'352	2'135'000	CHF/USD		-23'400.31	-0.01	b)
NZD/CHF	Verfall 11.03.2024		17'592	33'500	CHF/NZD		-359.02	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 11.03.2024		1'059'551	180'700'000	CHF/JPY		-4'061.70	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 11.03.2024		308'354	283'500	CHF/GBP		-7'058.28	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 11.03.2024		512'315	4'252'000	CHF/CNY		-7'197.83	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 11.03.2024		1'349'772	1'447'000	CHF/EUR		-28'011.59	-0.01	b)
AUD/CHF	Verfall 11.03.2024		162'576	288'900	CHF/AUD		-2'927.81	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 11.03.2024		95'245	148'400	CHF/CAD		-991.95	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 11.03.2024		70'000	60'829	USD/CHF		736.22	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 11.03.2024		30'334	35'000	CHF/USD		-449.24	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 11.03.2024		47'000	41'585	USD/CHF		-247.40	0.00	b)
<b>Klasse It hedged</b>							<b>-73'968.91</b>	<b>-0.03</b>	
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023		3'439'484	5'240'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		58'507'748	67'750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		9'668'223	8'700'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023		39'862'705	6'523'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		43'014'756	45'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.09.2023		16'441'387	135'570'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023		897'577	1'670'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023		5'791'183	9'940'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023		100'000'000	613'198	JPY/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		332'754	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		1'136'450	1'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 07.09.2023		1'500'000	182'561	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		900'000	791'089	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		700'812	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023		3'405'958	5'240'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023		10'010'943	9'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023		42'856'636	45'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 12.10.2023		869'480	1'670'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.10.2023		61'082'943	68'950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023		5'620'424	9'940'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 12.10.2023		16'279'182	134'070'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023		38'743'986	6'423'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		1'000'000	890'021	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		300'000	268'793	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		600'000	575'154	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023		130'000'000	791'300	JPY/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.10.2023		714'002	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023		478'755	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 12.10.2023		250'000	166'503	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 12.10.2023		1'000'000	122'543	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023		400'000	232'220	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		1'200'000	1'095'011	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023		20'000'000	122'900	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		450'000	434'888	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 12.10.2023		200'000	222'108	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 12.10.2023		1'500'000	187'232	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		300'000	274'735	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		400'000	387'091	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		500'000	460'636	USD/CHF		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.11.2023		909'479	1'670'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		60'047'210	66'450'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		38'213'297	6'273'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		9'749'353	8'800'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023		16'314'285	131'570'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		42'317'157	44'150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'317'137	4'990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		5'532'418	9'540'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		170'000'000	1'035'834		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		1'000'000	580'048		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		440'000	239'682		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'125'344	1'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		574'298	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		904'554	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		859'909	900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		787'436	130'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		371'601	3'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		500'000	449'201		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		220'646	1'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		500'000	450'968		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		700'000	670'482		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		60'000'000	363'222		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		1'400'000	804'703		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		1'600'000	197'008		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		61'401'531	67'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		648'933	1'230'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		37'153'867	6'173'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		9'686'644	8'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		43'148'314	44'950'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		16'685'604	134'770'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		4'104'393	7'140'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'261'444	4'990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		500'000	453'793		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		50'000'000	301'995		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		400'000	231'214		AUD/CHF	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		1'149'747	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'154'011	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		822'682	140'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		495'292	450'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		134'241	1'100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		196'352	340'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		700'000	619'840		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		600'000	345'602		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		529'693	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		591'135	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		210'004	1'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		59'999'039	69'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		37'495'696	6'363'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		657'873	1'230'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		10'141'950	9'250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		43'672'160	46'150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		16'725'761	137'570'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		3'188'425	4'990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		3'724'698	6'480'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		735'774	850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		756'895	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		870'235	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		1'500'000	1'305'758		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		2'500'000	304'298		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		210'000	197'567		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		20'000'000	118'932		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		474'979	550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		551'113	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		803'923	850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		692'514	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		591'122	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		750'678	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		449'768	3'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'420'302	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'020'928	1'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		1'294'259	218'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		725'504	680'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		247'120	390'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		292'392	510'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		258'518	2'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		76'472	144'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		800'000	681'749		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		60'000'000	356'388		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		850'000	790'138		EUR/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		250'000	269'071	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		931'700	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		1'500'000	856'166	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		62'634'240	73'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		727'956	1'374'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		38'441'843	6'501'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		10'992'578	10'180'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		45'178'048	48'640'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		3'412'647	5'380'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		3'121'257	5'490'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		16'713'409	141'070'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		1'400'000	1'214'892	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		1'200'000	1'130'734	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		105'000'000	616'367	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		660'000	725'837	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		370'000	237'597	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		580'000	69'787	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		245'000	129'800	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		145'000	82'543	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		5'700'000	4'921'038	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		2'300'000	2'144'808	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		760'000'000	4'447'946	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		2'105'511	3'700'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		680'000	744'340	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		7'900'000	949'525	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		375'000	240'687	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		931'296	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		704'261	120'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		1'414'401	1'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		218'325	200'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		215'167	1'800'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		59'278'469	68'250'000	CHF/USD		-748'042.57	-0.31	b)
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		592'891	1'129'000	CHF/NZD		-12'099.15	-0.01	b)
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		33'750'824	5'756'000'000	CHF/JPY		-129'381.16	-0.05	b)
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		2'974'789	4'635'000	CHF/CAD		-30'981.35	-0.01	b)
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		9'832'537	9'040'000	CHF/GBP		-225'068.44	-0.09	b)
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		16'192'382	134'390'000	CHF/CNY		-227'496.99	-0.09	b)
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		43'039'715	46'140'000	CHF/EUR		-893'196.23	-0.37	b)
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		5'089'992	9'045'000	CHF/AUD		-91'664.78	-0.04	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		2'000'000	1'737'464	USD/CHF		21'554.81	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		954'099	1'100'000	CHF/USD		-13'360.41	-0.01	b)
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		1'250'000	1'105'400	USD/CHF		-6'004.98	0.00	b)
<b>Klasse Nt hedged</b>							<b>-2'355'741.25</b>	<b>-0.98</b>	
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>-2'470'062.89</b>	<b>-1.02</b>	

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Vermögensaufstellung</b>		
Bankguthaben auf Sicht	1'447'987.17	0.60
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	240'689'797.49	99.79
Derivative Finanzinstrumente	-2'470'062.89	-1.02
Sonstige Vermögenswerte	1'525'086.03	0.63
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>241'192'807.80</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-8'950.48	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>241'183'857.32</b>	

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Bewertungskategorien</b>		
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);	240'689'797.49	99.79
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'470'062.89	-1.02
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
CNY	1 = CHF	0.12220950
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
JPY	100 = CHF	0.58832800
NZD	1 = CHF	0.53647509
USD	1 = CHF	0.88055000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	3'016'764.30	1.251
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	182'650'306.70	75.731

## 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	0.10	-	0.10	-
A hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
B	CHF	0.10	-	0.10	-
B hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
It	CHF	0.10	-	0.10	-
It hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
Nt	CHF	0.10	-	0.10	-
Nt hedged	CHF	0.10	-	0.10	-

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.09.2023 - 29.02.2024

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

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

## 8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Treasuries Total Return Index Value unhedged CHF

## 9 TER

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

## 10 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.