



BEKB OBLIGATIONEN NACHHALTIG GLOBAL

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	36598207	CHF
B	36598206	CHF
It	36598204	CHF
Nt	36598209	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	16
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	16
7	Verwaltungskommission	17
8	Benchmark	17
9	TER	17
10	Fussnoten	18
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19

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		199'935'360.98	185'382'956.90	230'434'901.81	215'580'792.48
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		938'703.31	880'789.48	979'947.13	1'174'486.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'369.467	11'455.467	11'992.467	12'038.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		75.89	76.89	81.71	97.56
Ausschüttung je Anteil		-	1.45	1.40	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'942'913.23	1'793'742.69	1'541'930.81	1'523'280.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'942.001	22'092.001	18'075.001	15'125.001
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		81.15	81.19	85.31	100.71
Thesaurierung je Anteil		-	1.50	1.46	1.53
Total Expense Ratio (TER)		0.90 %	0.90 %	0.90 %	0.90 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'397'217.88	5'395'647.89	5'604'880.37	6'664'475.27
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		63'737.807	63'737.807	63'237.807	63'926.653
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		84.68	84.65	88.63	104.25
Thesaurierung je Anteil		-	2.05	2.07	2.18
Total Expense Ratio (TER)		0.33 %	0.33 %	0.33 %	0.33 %
Klasse Nt	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		191'656'526.56	177'312'776.84	222'308'143.50	206'218'550.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'286'105.103	2'116'555.167	2'539'236.786	2'006'443.611
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		83.84	83.77	87.55	102.78
Thesaurierung je Anteil		-	2.28	2.33	2.45
Total Expense Ratio (TER)		0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	0.59 %	1.88 %	-16.69 %	-3.62 %
Klasse B	0.60 %	1.89 %	-16.70 %	-3.62 %
Klasse It	0.89 %	2.47 %	-16.23 %	-3.07 %
Klasse Nt	1.04 %	2.77 %	-15.97 %	-2.78 %
Benchmark	1.10 %	2.79 %	-13.65 %	-2.54 %
Tracking Error ³³⁾	0.85 %	0.98 %	1.32 %	0.43 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse A	-0.51 %
Klasse B	-0.50 %
Klasse It	-0.21 %
Klasse Nt	-0.06 %

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	2'419'114.79	4'110'774.24
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	198'502'494.80	180'857'892.64
Derivative Finanzinstrumente	-2'625'001.87	-1'177'373.93
Sonstige Vermögenswerte	1'646'682.86	1'599'666.23
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	199'943'290.58	185'390'959.18
Andere Verbindlichkeiten	-7'929.60	-8'002.28
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	199'935'360.98	185'382'956.90

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'455.467	11'992.467
Ausgegebene Anteile		1'764.000	863.000
Zurückgenommene Anteile		-850.000	-1'400.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'369.467	11'455.467
Klasse B			
	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'092.001	18'075.001
Ausgegebene Anteile		1'850.000	4'917.000
Zurückgenommene Anteile		-	-900.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		23'942.001	22'092.001
Klasse It			
	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		63'737.807	63'237.807
Ausgegebene Anteile		-	3'100.000
Zurückgenommene Anteile		-	-2'600.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		63'737.807	63'737.807
Klasse Nt			
	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'116'555.167	2'539'236.786
Ausgegebene Anteile		241'061.465	490'351.811
Zurückgenommene Anteile		-71'511.529	-913'033.430
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'286'105.103	2'116'555.167

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		185'382'956.90	230'434'901.81
Ausbezahlte Ausschüttung		-18'153.23	-15'648.45
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'787'998.75	-1'890'646.50
Saldo aus dem Anteilverkehr		14'292'105.92	-35'626'770.82
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		2'066'450.14	-7'518'879.14
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		199'935'360.98	185'382'956.90

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 29.02.2024	01.09.2022 31.08.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		19'738.90	18'018.59
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'241.05	-2'064.56
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'631'989.68	5'062'718.57
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		159'566.06	522'809.85
Total Ertrag		2'810'053.59	5'601'482.45
Aufwand			
Passivzinsen		-403.26	-216.74
Reglementarische Vergütungen		-48'139.51	-93'612.73
Sonstige Aufwendungen		0.00	-10.40
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-31'352.99	-493'151.40
Total Aufwand		-79'895.76	-586'991.27
Nettoertrag / Verlust		2'730'157.83	5'014'491.18
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-14'447'146.85	-15'773'290.09
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		39'904.61	177'927.48
Realisierter Erfolg		-11'677'084.41	-10'580'871.43
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		13'743'534.55	3'061'992.29
Gesamterfolg		2'066'450.14	-7'518'879.14

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							198'502'494.80	99.28	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							198'502'494.80	99.28	
XS2106056653	0.2500 % RBAIV 0 1/4 01/22/25 EMTN	0	500	0	500 EUR	96.72%	460'828.70	0.23	a)
AT							460'828.70	0.23	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	1'400	0	1'400	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000078552	1.5000 % TCV 1 1/2 11/20/30	2'000	0	0	2'000 AUD	83.01%	951'874.69	0.48	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'800	0	1'800	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	2'500	0	2'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	3'000	0	3'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	2'000	0	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	1'000	0	0	1'000 AUD	95.58%	548'032.90	0.27	a)
AU3CB0268126	2.2000 % CGJAU 2.2 11/06/26 MTN	500	0	0	500 AUD	93.59%	268'299.95	0.13	a)
AU3CB0271989	2.2500 % QTC 2 1/4 11/20/41	1'000	0	500	500 AUD	65.80%	188'627.31	0.09	a)
AU3CB0289817	3.9000 % NAB 3.9 05/30/25 MTN	475	0	0	475 AUD	99.14%	270'000.42	0.14	a)
AU3CB0293769	6.8600 % CBAAU 6.86 11/09/32 MTN	500	0	0	500 AUD	104.56%	299'752.17	0.15	a)
AU3CB0294502	4.9500 % NAB 4.95 11/25/27 MTN	500	0	0	500 AUD	100.80%	288'981.41	0.14	a)
AU3SG0000417	5.0000 % NSWTC 5 08/20/24 24	700	0	0	700 AUD	100.33%	402'674.75	0.20	a)
AU3SG0001647	4.2000 % QTC 4.2 02/20/47 47	1'000	0	0	1'000 AUD	86.35%	495'076.44	0.25	a)
AU3SG0001860	3.2500 % QTC 3 1/4 08/21/29	1'000	0	0	1'000 AUD	95.56%	547'912.50	0.27	a)
AU3SG0002223	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/42 MTN	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002256	2.0000 % TCV 2 11/20/37 MTN	1'500	0	1'000	500 AUD	68.54%	196'493.94	0.10	a)
AU3SG0002264	2.4000 % TCV 2.4 08/18/50 MTN	500	0	0	500 AUD	57.89%	165'956.25	0.08	a)
AU3SG0002421	0.5000 % TCV 0 1/2 11/20/25 MTN	500	0	0	500 AUD	94.00%	269'486.83	0.13	a)
AU3SG0002504	2.2500 % TCV 2 1/4 09/15/33	1'000	0	500	500 AUD	80.40%	230'497.66	0.12	a)
AU3SG0002710	4.7500 % TCV 4 3/4 09/15/36 MTN	600	0	0	600 AUD	96.82%	333'082.18	0.17	a)
AU3SG0002793	4.2500 % WATC 4 1/4 07/20/33	500	0	0	500 AUD	97.51%	279'540.87	0.14	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	2'600	0	2'600	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	1'900	0	1'900	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	2'600	0	2'600	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	4'000	0	4'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
US00205GAB32	4.2000 % APAAU 4.2 03/23/25 144A	0	500	0	500 USD	98.45%	433'458.65	0.22	a)
US00205GAC15	5.0000 % APAAU 5 03/23/35 144A	0	300	0	300 USD	92.73%	244'954.38	0.12	a)
US556079AC52	3.6240 % MQGAU 3.624 06/03/30 144A	500	0	0	500 USD	87.83%	386'680.22	0.19	a)
US80622GAE44	4.3750 % SCGAU 4 3/8 05/28/30 144A	500	0	0	500 USD	94.00%	413'848.48	0.21	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	800	0	0	800 USD	97.21%	684'814.30	0.34	a)
XS2315784715	0.7500 % APAAU 0 3/4 03/15/29 EMTN	650	0	0	650 EUR	85.59%	530'134.76	0.27	a)
AU							8'430'181.06	4.22	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002830116	0.7500 % PROXBB 0 3/4 11/17/36 EMTN	500	0	200	300 EUR	70.83%	202'472.47	0.10	a)
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	200	0	100	100 EUR	85.37%	81'346.70	0.04	a)
BE							283'819.17	0.14	
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	400	0	0	400 CAD	75.46%	195'959.47	0.10	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	2'000	2'200	0	4'200 CAD	99.40%	2'710'303.50	1.36	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	50	0	0	50 CAD	87.56%	28'422.22	0.01	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	50	650	0	700 CAD	97.37%	442'469.32	0.22	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	200	0	0	200 CAD	75.21%	97'658.70	0.05	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	800	0	0	800 CAD	89.27%	463'631.47	0.23	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	50	0	0	50 CAD	113.02%	36'686.76	0.02	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	50	0	0	50 CAD	110.31%	35'806.29	0.02	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	350	0	0	350 CAD	115.79%	263'088.94	0.13	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	300	0	0	300 CAD	106.76%	207'931.46	0.10	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.
CA135087Z568	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	50	0	0	50 CAD	100.96%	32'772.22	0.02	a)
CA44810ZAS98	4.8900 % HYDONE 4.89 03/13/37 MTN	500	0	0	500 CAD	101.66%	329'985.81	0.17	a)
CA448814JC89	2.1000 % QHEL 2.1 02/15/60 JR	250	0	0	250 CAD	61.38%	99'619.05	0.05	a)
CA47788ZAM38	2.8100 % DE 2.81 01/19/29	400	0	0	400 CAD	93.06%	241'669.72	0.12	a)
CA563469TM71	4.1000 % MP 4.1 03/05/41	800	0	0	800 CAD	95.09%	493'880.46	0.25	a)
CA563469UX18	2.0500 % MP 2.05 06/02/31	100	0	0	100 CAD	87.43%	56'760.46	0.03	a)
CA68323ACC68	3.4500 % ONT 3.45 06/02/45	400	0	0	400 CAD	87.38%	226'909.71	0.11	a)
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	300	0	0	300 CAD	87.21%	169'858.81	0.08	a)
CA803854KJ60	2.2000 % SCDA 2.2 06/02/30	100	0	0	100 CAD	90.14%	58'516.94	0.03	a)
CA891145T792	3.2260 % TD 3.226 07/24/24 DPNT	300	0	0	300 CAD	99.31%	193'411.98	0.10	a)
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	0	140	0	140 CAD	99.98%	90'868.79	0.05	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2027438899	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN	1'000	0	300	700 EUR	57.88%	386'090.24	0.19	a)
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CA							6'884'991.08	3.44	
CH0520042489	0.2500 % UBS 0 1/4 01/29/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	96.65%	1'105'199.88	0.55	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH							1'105'199.88	0.55	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	0	450	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	0	355	200	155 EUR	98.89%	146'057.49	0.07	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	0	510	250	260 EUR	95.53%	236'675.27	0.12	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	0	200	0	200 EUR	84.23%	160'513.21	0.08	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	0	1'010	650	360 EUR	84.87%	291'143.23	0.15	a)
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	5'400	2'940	2'460 EUR	99.02%	2'321'003.80	1.16	a)
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	200	325	0	525 EUR	116.28%	581'681.70	0.29	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	300	0	150	150 EUR	121.16%	173'175.60	0.09	a)
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.58%	445'849.37	0.22	a)
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	300	0	0	300 USD	99.46%	262'733.23	0.13	a)
US500769JD71	1.7500 % KFW 1 3/4 09/14/29	500	0	0	500 USD	87.28%	384'258.06	0.19	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	0	200	0	200 USD	100.00%	176'113.27	0.09	a)
XS0460071078	5.5200 % DB 5.52 09/01/28 EMTN	0	200	0	200 USD	100.69%	177'317.67	0.09	a)
XS2152899584	1.0000 % EOANGR 1 10/07/25 EMTN	0	400	0	400 EUR	96.35%	367'237.44	0.18	a)
DE							5'723'759.34	2.86	
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	500	0	0	500 GBP	91.05%	507'069.86	0.25	a)
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	2'000	190	900	1'290 GBP	103.82%	1'491'785.84	0.75	a)
DK							1'998'855.70	1.00	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	4'000	20	3'770	250 EUR	101.84%	242'601.73	0.12	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	0	1'290	0	1'290 EUR	109.48%	1'345'688.11	0.67	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	0	2'800	1'140	1'660 EUR	99.38%	1'572'042.61	0.79	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	0	45	0	45 EUR	93.95%	40'285.10	0.02	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	700	15	540	175 EUR	87.22%	145'450.02	0.07	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	800	140	660	280 EUR	90.37%	241'113.80	0.12	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	0	660	0	660 EUR	95.69%	601'778.44	0.30	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	500	0	450	50 EUR	86.18%	41'057.36	0.02	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	0	255	0	255 EUR	89.41%	217'243.40	0.11	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	600	720	720	600 EUR	69.62%	398'027.01	0.20	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	670	20	130	560 EUR	48.46%	258'584.34	0.13	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	0	510	0	510 EUR	71.79%	348'863.66	0.17	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	0	1'920	630	1'290 EUR	91.73%	1'127'612.27	0.56	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	0	780	220	560 EUR	82.81%	441'875.65	0.22	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	900	400	780	520 EUR	66.86%	331'280.96	0.17	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	1'000	10	860	150 EUR	95.49%	136'489.11	0.07	a)
XS2645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	99.33%	1'168'819.47	0.58	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.
X52676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	102.83%	293'960.71	0.15	a)
X52751598322	3.6250 % ENGSM 3 5/8 01/24/34 EMTN	0	500	0	500 EUR	97.79%	465'898.04	0.23	a)
ES							9'418'671.79	4.71	
US65559CAE12	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 144A	0	800	0	800 USD	90.71%	639'031.66	0.32	a)
X52185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	500	0	0	500 EUR	96.44%	459'480.37	0.23	a)
FI							1'098'512.03	0.55	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	2'700	240	860	2'080 EUR	112.99%	2'239'458.90	1.12	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	250	0	200	50 EUR	112.73%	53'709.27	0.03	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	600	410	0	1'010 EUR	100.04%	962'797.18	0.48	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	0	150	0	150 EUR	82.05%	117'276.12	0.06	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	1'100	2'600	0	3'700 EUR	93.28%	3'288'743.58	1.64	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	1'400	30	820	610 EUR	83.70%	486'513.67	0.24	a)
FR0013447125	2.1250 % CCAMA 2 1/8 09/16/29	500	0	0	500 EUR	90.34%	430'426.95	0.22	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	0	360	0	360 EUR	66.52%	228'188.89	0.11	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	0	1'110	0	1'110 EUR	83.44%	882'545.34	0.44	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	100	0	0	100 EUR	86.40%	82'331.03	0.04	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	0	200	0	200 EUR	59.94%	114'231.66	0.06	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	0	860	0	860 EUR	52.90%	433'504.76	0.22	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	0	1'520	0	1'520 EUR	93.75%	1'357'858.82	0.68	a)
FR001400DNF5	5.3750 % ENFP 5 3/8 06/30/42	0	500	300	200 EUR	117.16%	223'281.54	0.11	a)
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	103.15%	294'872.62	0.15	a)
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFP 5 1/2 10/09/28 EMTN	0	600	0	600 EUR	104.24%	595'982.82	0.30	a)
JP525021CKC7	0.4990 % BPCEGP 0.499 12/12/24 8	100'000	100'000	0	200'000 JPY	99.69%	1'172'961.30	0.59	a)
US05581KAB70	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659W2P81	2.8710 % BNP 2.871 04/19/32 144A	0	700	0	700 USD	83.65%	515'594.26	0.26	a)
US22535WAB37	4.1250 % ACAFP 4 1/8 01/10/27 144A	500	0	0	500 USD	96.83%	426'321.68	0.21	a)
X52451372499	1.2500 % ALDFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	800	0	400	400 EUR	94.66%	360'795.95	0.18	a)
FR							14'267'396.34	7.14	
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	500	0	0	500 AUD	99.17%	284'296.98	0.14	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	300	900	0	1'200 GBP	101.83%	1'361'082.25	0.68	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	360	400	225	535 GBP	100.21%	597'162.08	0.30	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	800	0	490	310 GBP	104.13%	359'554.68	0.18	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	400	0	40	360 GBP	100.46%	402'831.16	0.20	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	600	0	95	505 GBP	103.01%	579'426.22	0.29	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	0	1'050	0	1'050 GBP	83.31%	974'347.36	0.49	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	900	0	700	200 GBP	58.79%	130'966.69	0.07	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	500	315	0	815 GBP	95.98%	871'296.03	0.44	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	225	0	225 GBP	64.52%	161'697.85	0.08	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	900	0	900	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	700	780	0	1'480 GBP	63.94%	1'054'018.28	0.53	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	100	0	0	100 USD	122.30%	107'687.10	0.05	a)
US636274AE20	5.8090 % NGGLN 5.809 06/12/33	500	0	0	500 USD	101.05%	444'907.89	0.22	a)
US63859UBH59	1.5000 % NWIDE 1 1/2 10/13/26 144A	0	800	0	800 USD	90.72%	639'042.79	0.32	a)
US780097BG51	4.8920 % NWG 4.892 05/18/29	0	1'000	0	1'000 USD	97.31%	856'835.12	0.43	a)
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	500	0	0	500 USD	82.02%	361'093.28	0.18	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	100	0	0	100 USD	92.75%	81'673.72	0.04	a)
US92857WBZ23	5.7500 % VOD 5 3/4 02/10/63	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG84228FN34	6.1700 % STANLN 6.17 01/09/27 REGS	600	0	0	600 USD	100.81%	532'630.61	0.27	a)
X51961843171	3.0000 % HSBC 3 07/22/28	700	0	0	700 GBP	91.91%	716'634.38	0.36	a)
X52044910466	3.7500 % PSON 3 3/4 06/04/30	400	0	0	400 GBP	91.20%	406'319.74	0.20	a)
X52351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	97.45%	573'353.00	0.29	a)
X52659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.29%	113'935.89	0.06	a)
X52669894821	6.1250 % NWIDE 6 1/8 08/21/28 EMTN	400	0	0	400 GBP	103.44%	460'867.29	0.23	a)
X52675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.42%	390'365.83	0.20	a)
X52690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.49%	98'609.14	0.05	a)
GB							12'654'115.93	6.33	

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.
X52309433899	1.7500 % CROATI 1 3/4 03/04/41	0	180	0	180 EUR	74.90%	128'467.74	0.06	a)
HR							128'467.74	0.06	
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	0	1'010	0	1'010 EUR	86.51%	832'582.81	0.42	a)
X51108784510	4.5000 % SRENVX 4 1/2 09/11/44	2'000	0	0	2'000 USD	98.85%	1'740'776.91	0.87	a)
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	600	0	0	600 USD	81.32%	429'618.83	0.21	a)
IE							3'002'978.55	1.50	
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	0	250	0	250 EUR	109.36%	260'523.08	0.13	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	0	45	45	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	2'000	890	1'770	1'120 EUR	97.94%	1'045'233.79	0.52	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	2'000	790	0	2'790 EUR	88.70%	2'357'996.16	1.18	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	0	455	0	455 EUR	97.13%	421'123.05	0.21	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	1'050	35	1'085	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	1'000	400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	3'100	2'700	4'430	1'370 EUR	94.82%	1'237'840.96	0.62	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	0	195	195	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	0	3'085	760	2'325 EUR	81.22%	1'799'391.62	0.90	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	0	230	80	150 EUR	93.81%	134'080.70	0.07	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US465410AH18	6.8750 % ITALY 6 7/8 09/27/23	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52265521620	1.6250 % ADRIT 1 5/8 02/02/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.20%	429'755.17	0.21	a)
IT							7'685'944.53	3.84	
US90351DAF42	4.1250 % UBS 4 1/8 04/15/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	97.17%	855'650.26	0.43	a)
X52242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	1'000	0	0	1'000 EUR	96.16%	916'254.54	0.46	a)
JE							1'771'904.80	0.89	
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	0	880'000	0	880'000 JPY	100.01%	5'177'855.90	2.59	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	0	380'000	0	380'000 JPY	99.13%	2'216'084.49	1.11	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	250'000	0	250'000 JPY	98.32%	1'446'095.52	0.72	a)
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	270'000	0	270'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	25'000	0	25'000 JPY	101.06%	148'633.72	0.07	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	1'185'000	1'000'000	95'000	2'090'000 JPY	101.20%	12'443'116.02	6.22	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	155'000	0	110'000	45'000 JPY	103.32%	273'539.87	0.14	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	620'000	0	430'000	190'000 JPY	105.78%	1'182'433.38	0.59	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	0	385'000	0	385'000 JPY	111.11%	2'516'643.33	1.26	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	40'000	300'000	0	340'000 JPY	106.37%	2'127'735.28	1.06	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	70'000	0	30'000	40'000 JPY	94.91%	223'341.08	0.11	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	0	25'000	0	25'000 JPY	87.23%	128'299.63	0.06	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	100'000	90'000	0	190'000 JPY	117.34%	1'311'653.74	0.66	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	355'000	0	35'000	320'000 JPY	111.01%	2'089'891.67	1.05	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	215'000	0	15'000	200'000 JPY	103.99%	1'223'581.04	0.61	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	220'000	100'000	0	320'000 JPY	111.13%	2'092'226.15	1.05	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	100'000	0	0	100'000 JPY	104.13%	612'614.18	0.31	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	55'000	0	0	55'000 JPY	77.71%	251'444.62	0.13	a)
US65535HAZ29	2.3290 % NOMURA 2.329 01/22/27	0	800	0	800 USD	91.64%	645'534.16	0.32	a)
US86562MBP41	3.0400 % SUMIBK 3.04 07/16/29	0	800	0	800 USD	89.89%	633'227.20	0.32	a)
X52459747874	1.8500 % EJRAIL 1.85 04/13/33 EMTN	600	0	0	600 EUR	87.90%	502'550.69	0.25	a)
JP							37'246'501.67	18.63	
US88032XBD57	3.9400 % TENCNT 3.94 04/22/61 REGS	1'000	0	200	800 USD	73.70%	519'151.82	0.26	a)
KY							519'151.82	0.26	
X51310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	0	150	0	150 EUR	86.84%	124'128.31	0.06	a)
X52013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	150	15	40	125 EUR	65.55%	78'074.50	0.04	a)
LT							202'202.81	0.10	
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	500	0	300	200 EUR	57.33%	109'253.80	0.05	a)
X51960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	225	400	0	625 EUR	82.85%	493'438.75	0.25	a)
X52238787415	0.0000 % MDT 0 10/15/25	0	400	0	400 EUR	94.29%	359'393.31	0.18	a)
X52286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	75.91%	72'335.28	0.04	a)
X52397538252	1.3750 % HOLNSW 1 3/8 10/08/36 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU							1'034'421.14	0.52	

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.
XS2361416915	0.0000 % LATVIA 0 01/24/29 GMTN	0	200	0	200 EUR	86.13%	164'136.07	0.08	a)
LV							164'136.07	0.08	
US02364WAJ45	6.3750 % AMXLM 6 3/8 03/01/35	500	0	0	500 USD	108.35%	477'040.02	0.24	a)
US91087BAX82	6.3380 % MEX 6.338 05/04/53	0	1'500	0	1'500 USD	97.70%	1'290'419.23	0.65	a)
XS2363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	0	400	200	200 EUR	77.53%	147'744.57	0.07	a)
MX							1'915'203.82	0.96	
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	500	0	0	500 AUD	94.14%	269'882.45	0.13	a)
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	500	500	0	500 USD	103.18%	454'259.70	0.23	a)
US82620KAU79	3.4000 % SIEGR 3.4 03/16/27 144A	500	0	0	500 USD	95.85%	422'017.86	0.21	a)
XS1026109204	4.0000 % FREGR 4 02/01/24 REGS	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	99.03%	872'024.64	0.44	a)
XS1613121422	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 05/16/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1705553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	200	0	200	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	
XS2014382845	0.8750 % ALLRNV 0 7/8 06/24/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	82.46%	785'728.58	0.39	a)
XS2227050379	0.8750 % LUCSHI 0 7/8 09/08/32 EMTN	600	0	0	600 EUR	80.67%	461'226.05	0.23	a)
XS2332689764	0.7500 % DNFSDC 0 3/4 04/28/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	81.51%	233'005.71	0.12	a)
XS2475954579	1.8750 % PHIANA 1 7/8 05/05/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	94.23%	448'970.06	0.22	a)
XS2498042584	3.3750 % NEGANV 3 3/8 07/11/34 EMTN	450	0	200	250 EUR	98.87%	235'519.42	0.12	a)
XS2589790018	3.6250 % SIEGR 3 5/8 02/24/43	0	500	0	500 EUR	99.04%	471'886.91	0.24	a)
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	200	0	200 EUR	103.56%	197'359.30	0.10	a)
NL							4'851'880.68	2.43	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	600	300	0	900 NZD	97.25%	469'550.50	0.23	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	500	0	0	500 NZD	99.58%	267'098.66	0.13	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	600	0	0	600 NZD	92.86%	298'909.57	0.15	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	400	0	0	400 NZD	79.49%	170'583.80	0.09	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	500	350	0	850 NZD	99.02%	451'521.31	0.23	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	400	0	0	400 NZD	95.89%	205'766.87	0.10	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	550	0	0	550 NZD	63.01%	185'925.27	0.09	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	400	0	0	400 NZD	67.22%	144'239.53	0.07	a)
NZ							2'193'595.51	1.10	
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	200	0	0	200 USD	122.76%	216'187.87	0.11	a)
PE							216'187.87	0.11	
PTOTE5OE0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37	0	180	0	180 EUR	108.88%	186'743.04	0.09	a)
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45	0	160	0	160 EUR	109.03%	166'227.08	0.08	a)
PTOTECOEO037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	250	20	70	200 EUR	55.58%	105'926.33	0.05	a)
PTOTENOEO034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	0	180	0	180 EUR	78.31%	134'321.68	0.07	a)
PTOTEZOEO014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38	0	160	0	160 EUR	101.83%	155'248.33	0.08	a)
PT							748'466.46	0.37	
US83051GAU22	1.4000 % SEB 1.4 11/19/25 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86959LAP85	5.5000 % SHBASS 5 1/2 06/15/28 144A	500	0	0	500 USD	100.59%	442'870.87	0.22	a)
US87020PAM95	0.8500 % SWEDA 0.85 03/18/24 144A	400	0	0	400 USD	99.82%	351'575.44	0.18	a)
US87020PAV94	5.4720 % SWEDA 5.472 06/15/26 144A	400	0	0	400 USD	100.46%	353'850.22	0.18	a)
XS1195216707	0.7500 % STOCKL 0 3/4 02/26/25 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	500	0	0	500 EUR	91.51%	435'982.26	0.22	a)
XS2442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	90.19%	429'707.52	0.21	a)
XS2443485565	1.3000 % SWEDA 1.3 02/17/27 GMTN	0	500	0	500 EUR	92.61%	441'213.59	0.22	a)
SE							2'455'199.90	1.23	
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	500	0	0	500 USD	96.35%	424'187.72	0.21	a)
US716973AH54	5.3400 % PFE 5.34 05/19/63	1'000	0	500	500 USD	96.34%	424'179.07	0.21	a)
SG							848'366.79	0.42	
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	0	305	0	305 EUR	83.33%	242'184.41	0.12	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	0	300	0	300 EUR	79.28%	226'639.50	0.11	a)
SI							468'823.91	0.23	
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	0	510	0	510 EUR	66.94%	325'284.37	0.16	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	0	455	0	455 EUR	85.83%	372'113.20	0.19	a)
SK							697'397.57	0.35	
US002824BB55	2.9500 % ABT 2.95 03/15/25	800	0	0	800 USD	97.84%	689'253.97	0.34	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.
US02665WDW82	2.0000 % HND A 2 03/24/28 MTN	500	0	0	500 USD	89.57%	394'349.10	0.20	a)
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	500	0	0	500 USD	85.54%	376'629.23	0.19	a)
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	700	0	0	700 USD	83.50%	514'662.49	0.26	a)
US037833EA41	2.5500 % AAPL 2.55 08/20/60	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05351WAA18	3.1500 % AGR 3.15 12/01/24	0	500	0	500 USD	98.22%	432'429.30	0.22	a)
US05351WAC73	3.2000 % AGR 3.2 04/15/25	0	700	0	700 USD	97.27%	599'581.87	0.30	a)
US05565EBK01	3.9000 % BMW 3.9 04/09/25 144A	500	0	0	500 USD	98.60%	434'119.92	0.22	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	500	0	0	500 USD	85.56%	376'684.20	0.19	a)
US08652BAB53	1.9500 % BBY 1.95 10/01/30	500	0	0	500 USD	82.13%	361'605.90	0.18	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	100	0	0	100 USD	83.68%	73'684.56	0.04	a)
US149123CB51	3.8030 % CAT 3.803 08/15/42	0	400	0	400 USD	83.44%	293'903.17	0.15	a)
US149123CE90	4.7500 % CAT 4 3/4 05/15/64	0	700	0	700 USD	90.43%	557'368.14	0.28	a)
US14913Q3B33	2.1500 % CAT 2.15 11/08/24 MTN	800	0	0	800 USD	97.87%	689'400.21	0.34	a)
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	100	0	0	100 USD	96.88%	85'309.24	0.04	a)
US172967NE72	2.5200 % C 2.52 11/03/32	0	700	0	700 USD	81.16%	500'242.13	0.25	a)
US244199BF15	3.9000 % DE 3.9 06/09/42	0	400	0	400 USD	85.33%	300'562.92	0.15	a)
US24703TAB26	4.0000 % DELL 4 07/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642BB85	6.3000 % EBAY 6.3 11/22/32	800	0	0	800 USD	106.05%	747'061.78	0.37	a)
US30161NAQ43	4.9500 % EXC 4.95 06/15/35	0	300	0	300 USD	93.43%	246'798.80	0.12	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	500	0	0	500 USD	99.32%	437'300.19	0.22	a)
US37045XAS53	4.0000 % GM 4 01/15/25	800	0	0	800 USD	98.57%	694'373.55	0.35	a)
US37558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	800	0	0	800 USD	101.76%	716'834.67	0.36	a)
US38141GZP26	3.0000 % GS 3 03/15/24	0	1'500	0	1'500 USD	99.89%	1'319'385.30	0.66	a)
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	800	0	0	800 USD	100.04%	704'740.63	0.35	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	800	0	0	800 USD	81.93%	577'158.78	0.29	a)
US478160CF96	3.6250 % JNJ 3 5/8 03/03/37	0	500	0	500 USD	88.37%	389'052.98	0.19	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	600	500	0	1'100 USD	80.85%	783'119.48	0.39	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	500	0	0	500 USD	101.65%	447'544.78	0.22	a)
US594918AR51	3.5000 % MSFT 3 1/2 11/15/42	200	0	0	200 USD	83.81%	147'589.24	0.07	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	2'000	500	1'000	1'500 USD	69.02%	911'679.19	0.46	a)
US595112BV48	6.7500 % MU 6 3/4 11/01/29	500	0	0	500 USD	106.13%	467'258.13	0.23	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	300	0	0	300 USD	93.18%	246'145.98	0.12	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	600	0	0	600 USD	89.59%	473'330.86	0.24	a)
US713444FT00	4.6500 % PEP 4.65 02/15/53	0	600	0	600 USD	92.94%	491'004.15	0.25	a)
US742718FK01	3.6000 % PG 3.6 03/25/50	1'000	0	0	1'000 USD	82.03%	722'326.44	0.36	a)
US742718GF07	4.3500 % PG 4.35 01/29/29	0	500	0	500 USD	99.14%	436'499.02	0.22	a)
US742718GG89	4.5500 % PG 4.55 01/29/34	0	500	0	500 USD	98.68%	434'467.98	0.22	a)
US771196BS07	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 144A	800	0	0	800 USD	92.50%	651'628.85	0.33	a)
US771196CH33	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 144A	0	500	0	500 USD	104.48%	459'982.96	0.23	a)
US872898AD36	3.1250 % TASEM 3 1/8 10/25/41	800	0	500	300 USD	79.28%	209'426.22	0.10	a)
US882508BQ64	4.1000 % TXN 4.1 08/16/52	0	300	0	300 USD	83.67%	221'032.73	0.11	a)
US882508CJ13	5.1500 % TXN 5.15 02/08/54	0	700	0	700 USD	99.24%	611'701.57	0.31	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	0	2'700	1'200	1'500 USD	68.03%	898'573.76	0.45	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	3'300	2'100	1'200 USD	50.78%	536'585.16	0.27	a)
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	200	0	0	200 USD	68.94%	121'410.90	0.06	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	600	500	0	1'100 USD	89.13%	863'326.21	0.43	a)
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	58.13%	511'904.11	0.26	a)
US92928QAF54	3.5000 % URWFP 3 1/2 06/15/29 144A	500	0	0	500 USD	86.49%	380'799.56	0.19	a)
US95000U2Z51	4.6110 % WFC 4.611 04/25/53 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	87.25%	768'305.63	0.38	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	700	0	0	700 USD	97.56%	601'339.04	0.30	a)
US983024AN02	5.9500 % PFE 5.95 04/01/37	0	300	0	300 USD	106.70%	281'853.29	0.14	a)
XS1405775708	0.7500 % TMO 0 3/4 09/12/24	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1718480327	0.3750 % UPS 0 3/8 11/15/23	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1835955474	1.8120 % JPM 1.812 06/12/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	92.38%	880'226.02	0.44	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	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1914485534	1.1250 % SYK 1 1/8 11/30/23	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	500	0	0	500 EUR	91.58%	436'334.83	0.22	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	300	0	0	300 EUR	77.18%	220'622.04	0.11	a)
XS2363117321	0.3000 % HND A 0.3 07/07/28	1'000	0	500	500 EUR	87.37%	416'276.63	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	300	500	200	600 EUR	81.45%	465'691.26	0.23	a)
X52536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	100'000	0	0	100'000 JPY	100.01%	588'369.18	0.29	a)
X52680745382	4.6680 % NGGLN 4.668 09/12/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	104.98%	300'101.09	0.15	a)
US							28'589'902.99	14.30	
AU3C80258598	3.3500 % EUROF 3.35 05/21/29 MTN	500	0	0	500 AUD	93.75%	268'758.65	0.13	a)
AU3C80271914	1.5000 % IFC 1 1/2 04/15/35 MTN	500	0	0	500 AUD	70.28%	201'482.26	0.10	a)
EU000A1U9928	1.6250 % ESM 1 5/8 11/17/36 EMTN	400	400	400	400 EUR	85.24%	324'906.55	0.16	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	0	400	0	400 EUR	62.77%	239'265.21	0.12	a)
US045167CW12	2.0000 % ASIA 2 01/22/25 GMTN	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0BX51	3.2000 % IADB 3.2 08/07/42	14'900	300	11'000	4'200 USD	80.64%	2'982'418.03	1.49	a)
US4581X0CE61	4.3750 % IADB 4 3/8 01/24/44	2'600	0	2'000	600 USD	94.99%	501'867.39	0.25	a)
US4581X0DQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	0	2'000	0	2'000 USD	87.54%	1'541'725.09	0.77	a)
US4581X0DS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	700	4'600	0	5'300 USD	80.80%	3'770'855.19	1.89	a)
US4581X0DV77	0.8750 % IADB 0 7/8 04/20/26 GMTN	0	1'000	0	1'000 USD	92.40%	813'609.48	0.41	a)
US4581X0DX34	1.1250 % IADB 1 1/8 07/20/28	0	5'800	0	5'800 USD	87.06%	4'446'478.70	2.22	a)
US4581X0DZ81	0.5000 % IADB 0 1/2 09/23/24	6'000	1'500	2'300	5'200 USD	97.37%	4'458'435.98	2.23	a)
US4581X0EB05	1.5000 % IADB 1 1/2 01/13/27	0	2'000	0	2'000 USD	91.98%	1'619'812.81	0.81	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	4'000	2'500	2'500	4'000 USD	93.06%	3'277'876.22	1.64	a)
US459058EP48	2.5000 % IBRD 2 1/2 07/29/25 GDIF	7'000	500	0	7'500 USD	96.75%	6'389'164.63	3.20	a)
US459058FT50	1.8750 % IBRD 1 7/8 10/27/26 GDIF	1'000	2'000	0	3'000 USD	93.38%	2'466'847.29	1.23	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KT95	3.5000 % IBRD 3 1/2 07/12/28	4'700	0	0	4'700 USD	96.46%	3'992'063.53	2.00	a)
US45950KDA51	3.6250 % IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN	2'000	500	0	2'500 USD	98.15%	2'160'577.67	1.08	a)
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.77%	852'091.28	0.43	a)
X52296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	1'270	0	1'270 EUR	93.14%	1'127'193.19	0.56	a)
XS							41'435'429.15	20.72	

Derivative Finanzinstrumente

-2'625'001.87 -1.31

Devisentermingeschäfte

EUR/CHF	Verfall 07.09.2023	46'467'382	48'720'000		CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023	18'643'648	32'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	68'197'150	78'970'000		CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023	9'173'699	8'255'000		CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023	5'963'303	9'085'000		CHF/CAD	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023	1'905'335	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023	25'422'176	4'160'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	1'223'869	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023	1'654'871	270'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023	2'048'447	3'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	500'000	438'743		USD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023	356'438	320'000		CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 07.09.2023	200'000	190'875		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	600'000	527'393		USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	2'121'173	2'400'000		CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023	26'722'070	4'430'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023	5'905'177	9'085'000		CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023	46'106'518	48'520'000		CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	72'351'616	81'670'000		CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023	9'538'204	8'575'000		CHF/GBP	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 12.10.2023	1'845'694	3'545'000		CHF/NZD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023	20'129'486	35'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	1'070'419	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	535'501	600'000		CHF/USD	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	200'000	191'582		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023	30'000'000	181'955		JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 12.10.2023	250'000	166'503		CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	1'100'000	1'007'360		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	700'000	677'410		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023	500'000	293'700		AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	900'000	826'978		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023	240'000	139'177		AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/NZD	Verfall 12.10.2023	200'000	108'226		NZD/CHF	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 02.11.2023	1'821'680	3'345'000		CHF/NZD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2023	73'619'958	81'470'000		CHF/USD	0.00	0.00

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 02.11.2023		9'500'080	8'575'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		26'803'524	4'400'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		5'873'128	8'835'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		45'643'103	47'620'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		20'215'941	34'860'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		500'000	479'346		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		548'146	90'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		850'000	941'901		GBP/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		231'919	400'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'986'796	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'328'828	1'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		120'000'000	726'192		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		800'000	717'534		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		700'000	398'468		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		300'000	283'709		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		700'000	627'134		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		1'800'000	1'624'937		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		1'400'000	1'337'176		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		50'000'000	302'685		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		72'892'777	80'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		1'764'782	3'345'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		26'001'086	4'320'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		8'503'332	7'725'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'774'521	8'835'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		44'943'361	46'820'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		19'866'643	34'560'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		601'757	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		350'000	228'907		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		800'000	462'428		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		722'726	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		768'278	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		232'255	400'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		627'249	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		110'422	170'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		299'149	520'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		795'979	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		480'838	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		264'434	45'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		231'136	210'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		162'225	280'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		441'411	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		623'916	650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		254'804	440'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		699'605	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		72'786'713	84'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		1'789'093	3'345'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		26'311'218	4'465'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		8'700'148	7'935'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		46'151'490	48'770'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		20'347'885	35'400'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		5'530'225	8'655'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		2'784'752	3'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		609'104	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		705'297	750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		565'687	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'209'039	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		570'329	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		297'601	270'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		231'716	360'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		80'367	150'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		405'381	700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		427'626	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		564'344	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		194'830	180'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		51'400	80'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		139'360	240'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		301'595	50'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		200'661	350'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		34'503	65'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		400'000	340'874		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		400'000	371'830		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		17'000'000	100'985		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		110'000	118'397		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		400'000	228'897		AUD/CHF	0.00	0.00	

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 11.01.2024		100'000	63'855		CAD/CHF	0.00	0.00		
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		1'886'116	3'560'000		CHF/NZD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		26'597'664	4'498'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		76'036'437	89'470'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		8'935'519	8'275'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		20'632'135	36'290'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		47'295'769	50'920'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		5'705'717	8'995'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		532'340	570'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		500'000	433'890		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		450'000	424'025		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		250'000	274'938		GBP/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		120'000	77'073		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		390'000	221'976		AUD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		60'000	31'811		NZD/CHF	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		7'429'754	1'270'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		13'200'000	7'514'522		AUD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		1'398'209	1'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		1'885'869	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		430'598	500'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		5'183'147	880'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		596'886	640'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		8'900'000	5'019'600		AUD/CHF	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		327'693	300'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		79'619'887	91'670'000		CHF/USD	-1'004'733.52	-0.50	b)	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		9'054'853	8'325'000		CHF/GBP	-207'267.13	-0.10	b)	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		38'981'146	6'648'000'000		CHF/JPY	-149'431.19	-0.07	b)	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		1'838'015	3'500'000		CHF/NZD	-37'508.41	-0.02	b)	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		49'606'676	53'180'000		CHF/EUR	-1'029'479.32	-0.51	b)	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		5'696'064	8'875'000		CHF/CAD	-59'322.43	-0.03	b)	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		7'765'826	13'800'000		CHF/AUD	-139'853.42	-0.07	b)	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		800'000	694'986		USD/CHF	8'621.93	0.00	b)	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		250'000	233'253		EUR/CHF	4'788.87	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		2'021'916	2'300'000		CHF/USD	-965.54	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		1'425'825	1'500'000		CHF/EUR	-2'434.38	0.00	b)	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		374'287	690'000		CHF/NZD	4'536.04	0.00	b)	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		432'510	390'000		CHF/GBP	-1'394.25	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		845'940	1'300'000		CHF/CAD	2'892.50	0.00	b)	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		1'254'639	214'000'000		CHF/JPY	-4'979.20	0.00	b)	
	CHF/AUD Verfall 11.03.2024		1'950'000	1'124'717		AUD/CHF	-7'598.65	0.00	b)	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		568'005	510'000		CHF/GBP	590.58	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		614'624	700'000		CHF/USD	-1'035.54	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		659'207	750'000		CHF/USD	-428.81	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte								-2'625'001.87	-1.31	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'419'114.79	1.21
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	198'502'494.80	99.28
Derivative Finanzinstrumente	-2'625'001.87	-1.31
Sonstige Vermögenswerte	1'646'682.86	0.82
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	199'943'290.58	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-7'929.60	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	199'935'360.98	

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);	198'502'494.80	99.28
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a) verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'625'001.87	-1.31
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
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	2'060'732.60	1.031
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	203'538'099.00	101.802

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	0.15	-	0.15	-
B	CHF	0.15	-	0.15	-
It	CHF	0.15	-	0.15	-
Nt	CHF	0.15	-	0.15	-

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.09.2023 - 29.02.2024

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

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

8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Excluding Securitized Total Return Index hedged CHF

9 TER

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

10 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: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

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.