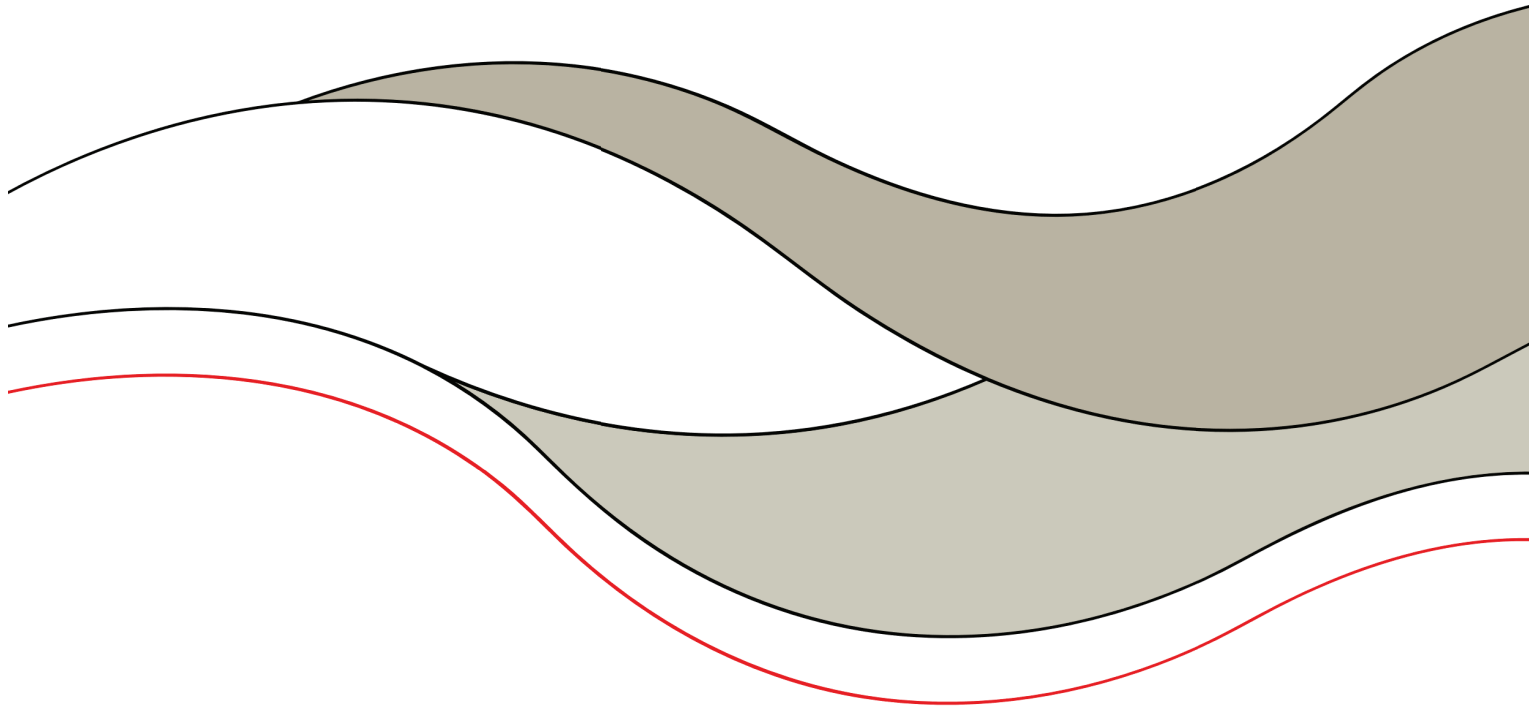


Halbjahresbericht 2023

Ungeprüfter Halbjahresbericht
per 30. November 2023



Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable
UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable
UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)
UBS (CH) Bond Fund – Enhanced Yield Short Term (CHF)

Inhaltsverzeichnis

Anlagekategorie und ISIN	3
Organisation	4
UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable	5
UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable	20
UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)	38
UBS (CH) Bond Fund – Enhanced Yield Short Term (CHF)	56

Verkaufsrestriktionen

Anteile der Teilvermögen dürfen innerhalb der USA weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Anteile der Teilvermögen dürfen Bürgern der USA oder Personen mit Wohnsitz in den USA und/oder anderen natürlichen oder juristischen Personen, deren Einkommen und/oder Ertrag, ungeachtet der Herkunft, der US-Einkommensteuer unterliegt, sowie Personen, die gemäss Regulation S des US Securities Act von 1933 und/oder dem US Commodity Exchange Act in der jeweils aktuellen Fassung als US-Personen gelten, weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden. Eine US Person ist eine Person, die:

- (i) eine United States Person im Sinne von Paragraph 7701(a)(30) des US Internal Revenue Code von 1986 in der geltenden Fassung sowie der in dessen Rahmen erlassenen Treasury Regulations ist;
- (ii) eine US Person im Sinne von Regulation S des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (17 CFR § 230.902(k)) ist;
- (iii) keine Non-United States Person im Sinne von Rule 4.7 der US Commodity Futures Trading Commission Regulations (17 CFR § 4.7(a)(1)(iv)) ist;
- (iv) sich im Sinne von Rule 202(a)(30)-1 des US Investment Advisers Act von 1940 in der geltenden Fassung in den Vereinigten Staaten aufhält; oder
- (v) ein Trust, eine Rechtseinheit oder andere Struktur ist, die zu dem Zweck gegründet wurde, dass US Persons in diesen Umbrella-Fonds bzw. in die Teilvermögen investieren können.

Anlagekategorie und ISIN

UBS (CH) Bond Fund –

CHF Corporates Sustainable

F CH0503145192

Bonds CHF Sustainable

I-X CH0540307235

P CH0002791843

Q CH0203279580

U-X CH0111018120

Global (CHF)

P CH0002788526

Q CH0203279556

Enhanced Yield Short Term (CHF)

I-A1 CH0589362521

I-B CH0594826163

I-X CH0560699891

P CH0567473944

Q CH0567473951

Organisation

Fondsleitung

UBS Fund Management (Switzerland) AG
Aeschenvorstadt 1, 4002 Basel

Verwaltungsrat

Michael Kehl

Präsident

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Dr. Daniel Brüllmann

Vizepräsident

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Francesca Gigli Prym

Mitglied

Managing Director, UBS Fund Management
(Luxembourg) S.A., Luxemburg

Dr. Michèle Sennhauser

Mitglied

Executive Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Franz Gysin

Unabhängiges Mitglied

Werner Strebel

Unabhängiges Mitglied

Geschäftsleitung

Eugène Del Cioppo

CEO

Georg Pfister

Stellvertretender CEO sowie
Operating Office, Finance, HR

Urs Fäs

Real Estate Fund

Christel Müller

Business Risk Management

Thomas Reisser

Compliance & Operational Risk Control

Matthias Börlin

Admin, Custody & Tax Oversight

Daniel Diaz

Delegation & Investment Risk Management

Melanie Gut

Corporate & Regulatory Governance

Patric Schläpfer

Corporate Services

Hubert Zeller

White Labelling Solutions Schweiz

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Basel

Übertragung der Anlageentscheide

UBS (CH) Bond Fund

- CHF Corporates Sustainable

- Bonds CHF Sustainable

- Enhanced Yield Short Term (CHF)

UBS Asset Management Switzerland AG, Zürich

UBS (CH) Bond Fund

- Global (CHF)

UBS Asset Management (UK) Ltd, London

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die Administration des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel, übertragen. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen den Parteien abgeschlossenen Vertrag geregelt. Alle anderen Aufgaben der Fondsleitung wie auch die Kontrolle der übertragenen weiteren Aufgaben werden in der Schweiz ausgeführt.

Zahlstellen

UBS Switzerland AG, Zürich

und ihre Geschäftsstellen in der Schweiz

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable

Art Effektenfonds

Wichtigste Daten

	ISIN	30.11.2023	31.5.2023	31.5.2022
Nettofondsvermögen in CHF		1 545 514 230.92	1 459 959 233.84	1 193 418 340.35
Klasse F	CH0503145192			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		95.47	93.11	92.89
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		95.72	93.76	93.15
Anzahl Anteile im Umlauf		16 188 599,6680	15 680 498,5270	12 847 671,7360

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

Schweiz	41,06
Deutschland	9,21
Vereinigte Staaten von Amerika	8,83
Frankreich	7,91
Grossbritannien	5,61
Kanada	4,31
Australien	4,11
Spanien	3,64
Vereinigte Arabische Emirate	1,74
Österreich	1,67
Übrige	11,02
TOTAL	99,11

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.11.2023	31.5.2023
Verkehrswerte	CHF	CHF
Bankguthaben		
– auf Sicht	3 275 247.82 ¹	7 059 414.46
Geldmarktinstrumente	8 995 452.30	0.00
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 540 499 152.91	1 470 440 713.93
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	4 445.70	7 498 955.00
Derivative Finanzinstrumente	-75 760.20	-138 903.00
Sonstige Vermögenswerte	10 690 618.72	8 839 554.37
Gesamtfondsvermögen	1 563 389 157.25	1 493 699 734.76
Aufgenommene Kredite	-17 634 778.24	-33 526 391.88
Andere Verbindlichkeiten	-240 148.09	-214 109.04
Nettofondsvermögen	1 545 514 230.92	1 459 959 233.84

Erfolgsrechnung

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
Ertrag	CHF	CHF
Erträge der Bankguthaben	55 247.60	19 513.67
Negativzinsen	-16 108.17	-67 137.30
Erträge der Geldmarktinstrumente	12 650.00	7 440.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	9 477 450.81	11 052 380.10
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	572 395.89	808 265.16
Erträge der Effektenleihe	95 891.32	150 372.48
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	289 262.56	495 115.92
TOTAL Ertrag	10 486 790.01	12 465 950.03
Aufwand		
Passivzinsen	-12.55	-2 952.07
Prüfaufwand	0.00	-13 069.40
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse F	-1 364 491.68	-2 305 791.53
Sonstige Aufwendungen	-2 399.75	-4 817.52
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-249 383.17	-168 303.69
TOTAL Aufwand	-1 616 287.15	-2 494 934.21
Nettoertrag	8 870 502.86	9 971 015.82
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ²	-7 511 548.50	-13 512 775.95
Realisierter Erfolg	1 358 954.36	-3 541 760.13
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	39 501 846.40	13 430 523.72
Gesamterfolg	40 860 800.76	9 888 763.59

¹ Zum 30. November 2023 wurden gegenüber UBS AG London Bankguthaben in Höhe von CHF 440 000.00 als Sicherheiten hinterlegt.

² Realisierte Kapitalgewinne und -verluste können Aufwendungen und Erträge aus Swinging Single Pricing enthalten.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 459 959 233.84	1 193 418 340.35
Abgeführte Verrechnungssteuer	-2 677 086.23	-2 864 908.59
Saldo aus dem Anteilverkehr	47 371 282.55	259 517 038.49
Gesamterfolg	40 860 800.76	9 888 763.59
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 545 514 230.92	1 459 959 233.84

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
Klasse F	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	15 680 498,5270	12 847 671,7360
Ausgegebene Anteile	1 838 237,6300	4 327 420,0340
Zurückgenommene Anteile	-1 330 136,4890	-1 494 593,2430
Bestand Ende Berichtsperiode	16 188 599,6680	15 680 498,5270
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	508 101,1410	2 832 826,7910

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 1.87500% 20-22.11.29*	CHF	800 000					
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 2.37500% 20-22.11.29*	CHF	300 000					
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 4.00000% 22-16.12.31*	CHF	2 700 000			2 700 000	2 733 906	0,17
SWISS AUTO LEASE GMBH-REG-S STEP-UP 20-23.03.30*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 984 264	0,13
SWISS CAR ABS 2020-1 AG-REG-S STEP-UP 20-18.08.30*	CHF	1 500 000		1 500 000			
SWISS CAR ABS-REG-S STEP-UP/DOWN 21- 18.04.31*	CHF	2 330 000			2 330 000	2 314 059	0,15
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 1.75000% 20-15.06.25*	CHF	2 000 000		2 000 000			
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 2.50000% 20-15.06.25*	CHF	1 000 000		1 000 000			
TOTAL CHF					7 032 229	0,45	
Total Asset Backed Securities, fester Zins					7 032 229	0,45	

Notes, fester Zins

CHF								
ABB LTD 2.11250% 23-22.09.33*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 073 000	0,13	20 000
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.95000% 21-25.03.31*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 234 000	0,21	
AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEILIG-REG-S 1.45000% 20-23.07.27*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 640 500	0,10	
AMAG LEASING AG-REG-S 3.01250% 23-04.09.29*	CHF		2 500 000		2 500 000	2 542 500	0,16	
AXPO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 22-04.02.25*	CHF	2 085 000			2 085 000	2 041 632	0,13	
AXPO HOLDING AG-REG-S 2.00000% 22-15.09.26*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 501 750	0,22	
AXPO HOLDING AG-REG-S 2.50000% 23-22.09.26*	CHF		7 500 000		7 500 000	7 586 250	0,49	
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.85000% 22-21.01.32*	CHF	3 860 000		55 000	3 915 000	3 441 285	0,22	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.18000% 21-20.04.29*	CHF	4 180 000		2 180 000	2 000 000	1 820 000	0,12	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 2.41130% 23-08.08.29*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 108 000	0,39	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 2.66500% 23-28.06.30*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 160 000	0,33	
CLARIANT AG-REG-S 2.71700% 22-24.09.27*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 081 000	0,39	
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.07000% 20-18.09.29*	CHF	1 650 000			1 650 000	1 492 425	0,10	
EQUINIX EUR 1 FINANCING CORP LLC-REG-S 2.87500% 23-12.09.28*	CHF		3 135 000		3 135 000	3 238 455	0,21	
FLUGHAFEN ZURICH AG-REG-S 0.10000% 20-30.12.27*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 880 000	0,12	400 000
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF	3 850 000			3 850 000	3 764 145	0,24	
LANDESBK HESSEN-THUERIN GIROZ-REG-S-SUB 4.24250% 23-25.07.33*	CHF		6 200 000		6 200 000	6 503 800	0,42	
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF	4 265 000			4 265 000	4 113 593	0,26	
LONZA SWISS FINANZ AG 2.60000% 23-16.05.31*	CHF		3 600 000		3 600 000	3 744 000	0,24	
NESTLE SA 1.87500% 23-20.11.31*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 171 000	0,39	
NESTLE SA 2.00000% 23-20.11.36*	CHF	6 500 000			6 500 000	6 812 000	0,44	
NESTLE SA-REG-S 2.00000% 23-28.06.33*	CHF		7 000 000		7 000 000	7 269 500	0,46	
NESTLE SA-REG-S 2.12500% 22-15.07.30*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 252 000	0,40	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.55000% 19-04.02.28*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 133 228	0,07	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.15000% 20-02.02.29*	CHF	3 200 000			3 200 000	2 928 000	0,19	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.50000% 22-25.02.27*	CHF	6 000 000		2 000 000	4 000 000	3 882 000	0,25	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 2.00000% 22-23.09.32*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 217 500	0,33	
ROCHE KAPITALMARKT AG 1.75000% 23-15.09.33*	CHF		7 000 000		7 000 000	7 129 780	0,46	
SANDOZ GROUP AG-REG-S 2.60000% 23-17.11.31*	CHF	3 750 000			3 750 000	3 918 750	0,25	
SGS SA-REG-S 2.00000% 23-17.11.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 036 000	0,26	
SGS SA-REG-S 2.30000% 23-17.11.31*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 136 000	0,26	
SIKA AG 2.25000% 23-13.04.29*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 100 000	0,26	
SIKA AG-REG-S 1.90000% 22-28.11.25*	CHF	3 310 000		1 310 000	2 000 000	2 006 000	0,13	
SIKA AG-REG-S 2.35000% 22-28.11.28*	CHF	6 855 000			6 855 000	7 050 368	0,45	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.50000% 20-06.10.25*	CHF	2 375 000			2 375 000	2 320 375	0,15	
SULZER AG 0.87500% 20-18.11.27*	CHF	2 575 000		2 000 000	575 000	551 425	0,04	
SULZER AG-REG-S 0.80000% 20-23.09.25*	CHF	2 600 000			2 600 000	2 545 400	0,16	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.25880% 23-26.07.28*	CHF	3 065 000		705 000	2 360 000	2 430 800	0,16	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.61000% 23-26.01.32*	CHF	4 300 000			4 300 000	4 549 400	0,29	
SWISSCOM AG-REG-S 1.87500% 23-23.08.30*	CHF	5 835 000		1 835 000	4 000 000	4 086 000	0,26	
SWISSGRID AG-REG-S 1.90000% 23-30.06.26*	CHF		2 230 000		2 230 000	2 241 150	0,14	
TECAN GROUP AG-REG-S 0.05000% 21-06.10.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 904 000	0,19	
TRANSPower NEW ZEALAND LTD 0.03750% 21-16.03.29*	CHF	1 430 000			1 430 000	1 325 610	0,08	
UBS GROUP AG-REG-S 0.43500% 21-09.11.28*	CHF	6 800 000	3 400 000	2 000 000	8 200 000	7 568 600	0,48	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.19250% 21-24.03.28*	CHF	6 100 000	1 800 000		7 900 000	7 378 600	0,47	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
ZUERCHER KANTONALBANK 1.40000% 22-25.07.29*	CHF	1 875 000		1 875 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.75000% 23-19.04.28*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 115 000	0,33	
TOTAL CHF						185 024 820	11,83	
Total Notes, fester Zins						185 024 820	11,83	

Notes, Nullcoupon

CHF

CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.10.30*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 314 750	0,08	
TOTAL CHF						1 314 750	0,08	
Total Notes, Nullcoupon						1 314 750	0,08	

Notes, variabler Zins

CHF

HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGS-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-PRP*	CHF	6 500 000			6 500 000	6 006 000	0,38	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-PRP*	CHF	2 400 000	100 000		2 500 000	1 862 500	0,12	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 1.750%/VAR 21-PRP*	CHF	5 800 000			5 800 000	5 524 500	0,35	5 595 000
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-30.09.41*	CHF	6 000 000			6 000 000	5 406 000	0,35	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP*	CHF		200 000		200 000	176 750	0,01	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.375%/VAR 22-PRP*	CHF	6 000 000	200 000		6 200 000	5 378 500	0,34	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-PRP*	CHF	1 675 000	100 000		1 775 000	1 529 163	0,10	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 1.500%/VAR 22-03.05.52*	CHF	6 500 000			6 500 000	5 736 250	0,37	
TOTAL CHF						31 619 663	2,02	
Total Notes, variabler Zins						31 619 663	2,02	

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF

ABN AMRO BANK NV 2.50500% 23-26.06.28*	CHF		5 000 000	400 000	4 600 000	4 733 400	0,30	200 000
ABN AMRO BANK NV-REG-S 0.30000% 16-18.12.24*	CHF	500 000		500 000				
ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.62500% 23-02.03.28*	CHF	4 800 000		2 000 000	2 800 000	2 844 800	0,18	
ACHMEA BANK NV-REG-S 0.50000% 17-03.10.25*	CHF	700 000			700 000	682 500	0,04	
ACHMEA BANK NV-REG-S 2.74750% 23-16.10.30*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 019 500	0,07	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.72500% 18-15.02.24*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 195 080	0,08	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24*	CHF	500 000			500 000	490 000	0,03	
ADECCO SA-REG-S 0.87500% 20-27.11.25*	CHF	4 500 000			4 500 000	4 421 250	0,28	
ADECCO SA-REG-S 2.37750% 22-17.11.27*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 061 500	0,20	
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23*	CHF	1 875 000			1 875 000	1 872 188	0,12	
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23*	CHF	1 350 000		1 350 000				
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24*	CHF	1 600 000	1 000 000		2 600 000	2 536 560	0,16	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF	3 250 000		3 250 000				
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF	4 600 000	5 200 000		9 800 000	9 141 440	0,58	
ASB BANK LTD-REG-S 0.20000% 17-02.08.24*	CHF	7 000 000		7 000 000				
ASB BANK LTD-REG-S 0.45000% 19-30.01.25*	CHF	4 790 000		2 000 000	2 790 000	2 742 012	0,18	
ASB BANK LTD-REG-S 0.11750% 21-29.06.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 769 000	0,18	
AUCHAN HOLDING SA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 190 640	0,08	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.40750% 22-28.11.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 030 000	0,19	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.77000% 22-28.11.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 118 500	0,20	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S-SUB 1.60000% 17-24.05.27*	CHF		3 200 000		3 200 000	3 103 536	0,20	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24*	CHF	2 650 000			2 650 000	2 605 215	0,17	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.25000% 19-24.09.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 753 000	0,11	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF	6 455 000			6 455 000	6 070 928	0,39	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF	2 645 000			2 645 000	2 495 558	0,16	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24*	CHF	1 775 000			1 775 000	1 749 618	0,11	
BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 0.29750% 21-22.10.26*	CHF	800 000			800 000	756 800	0,05	800 000
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24*	CHF	4 510 000			4 510 000	4 460 841	0,29	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.20000% 19-19.11.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	935 000	0,06	135 000
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.31000% 21-09.06.28*	CHF	4 150 000			4 150 000	3 874 025	0,25	
BANK FUER ARBEIT UN WIRTSCHAFT AG 2.05250% 23-14.04.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 042 000	0,19	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF	8 950 000		5 950 000	3 000 000	2 881 500	0,18	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.42250% 21-23.11.29*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	1 819 000	0,12	
BANK OF MONTREAL-REG-S 2.26000% 23-01.02.29*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 108 000	0,39	
BANK OF NEW ZEALAND 0.362500% 21-14.12.29*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 639 800	0,10	
BANK OF NOVA SCOTIA DN-REG-S 0.14250% 21-25.10.28*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 378 500	0,09	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.30250% 21-30.07.31*	CHF	8 350 000		2 350 000	6 000 000	5 265 000	0,34	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.38500% 22-01.02.29*	CHF	3 700 000		1 700 000	2 000 000	1 849 000	0,12	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.04250% 23-04.05.26*	CHF	5 500 000		2 500 000	3 000 000	3 030 000	0,19	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.38250% 23-22.09.27*	CHF		6 000 000		6 000 000	6 126 000	0,39	
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.25000% 19-10.07.25*	CHF	500 000		500 000				
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 19-12.06.26*	CHF	500 000		500 000				
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 20-03.11.28*	CHF	2 700 000			2 700 000	2 485 350	0,16	
BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL-REG-S 2.73000% 23-11.07.30*	CHF		6 400 000		6 400 000	6 697 600	0,43	
BANQUE FEDERATIVE D CREDIT MUTUEL-REG-S 0.60000% 17-05.04.27*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 300 400	0,15	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 1.00000% 18-13.11.26*	CHF	1 500 000		500 000	1 000 000	977 500	0,06	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.25000% 21-21.06.29*	CHF	2 970 000		1 600 000	1 370 000	1 250 125	0,08	
BANQUE FEDERTVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.30000% 23-30.01.27*	CHF	7 000 000		2 000 000	5 000 000	5 085 000	0,33	
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S 1.00000% 19-10.07.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	976 000	0,06	
BARCLAYS PLC-REG-S 0.31500% 21-04.06.27*	CHF	7 000 000		2 000 000	5 000 000	4 705 000	0,30	
BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WI-REG-S 2.95500% 22-29.11.27*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 547 500	0,16	
BERLIN HYP AG 0.25000% 21-04.10.29*	CHF	3 750 000			3 750 000	3 406 875	0,22	
BERLIN HYP AG 2.25000% 23-08.11.27*	CHF		2 300 000		2 300 000	2 332 200	0,15	
BERLIN HYP AG-REG-S 0.25000% 20-11.09.28*	CHF	6 045 000	1 000 000		7 045 000	6 506 058	0,42	
BERLIN HYP AG-REG-S 0.96750% 22-04.08.26*	CHF	2 500 000		2 500 000				
BERLIN-HANNOVERSCHE HYPOTHKNBNK-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	1 500 000		500 000	1 000 000	876 500	0,06	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.75000% 19-03.09.27*	CHF	1 000 000		1 000 000				
BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28*	CHF	5 200 000			5 200 000	4 867 200	0,31	
BNP PARIBAS SA 2.41250% 23-13.01.28*	CHF	6 000 000		2 000 000	4 000 000	4 094 000	0,26	
BNP PARIBAS SA 2.89250% 22-27.09.29*	CHF	4 200 000		1 200 000	3 000 000	3 111 000	0,20	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.30000% 19-15.10.27*	CHF	1 000 000		1 000 000				
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.15000% 20-10.03.28*	CHF	4 800 000	1 800 000		6 600 000	6 085 200	0,39	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.14750% 21-13.07.27*	CHF	15 200 000		5 200 000	10 000 000	9 360 000	0,60	
BNP PARIBAS SA-REG-S 2.63000% 23-07.06.29*	CHF	3 000 000		2 000 000	1 000 000	1 036 850	0,07	
BNP PARIBAS-REG-S 0.50000% 21-16.03.29*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 008 600	0,13	
BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25*	CHF	2 750 000		750 000	2 000 000	1 970 000	0,13	
BNP PARIBAS-SUB 1.75000% 15-05.06.25*	CHF	380 000			380 000	377 340	0,02	
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.11100% 20-24.07.28*	CHF	6 900 000			6 900 000	6 361 800	0,41	
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF	3 000 000		3 000 000				
CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.75000% 23-24.02.31*	CHF	2 000 000		2 000 000				
CAIXABANK SA-REG-S 0.47700% 21-01.07.27*	CHF	9 400 000		2 400 000	7 000 000	6 601 000	0,42	
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.05000% 19-15.10.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	952 500	0,06	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.28250% 22-03.02.27*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 898 000	0,12	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.96750% 22-26.04.29*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 916 000	0,19	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF	550 000		550 000				
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 442 250	0,22	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF	3 700 000			3 700 000	3 666 700	0,23	
CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26*	CHF	4 860 000			4 860 000	4 723 920	0,30	
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 0.77500% 20-18.02.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 834 000	0,25	
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.11750% 20-17.07.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 870 000	0,31	
CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA-REG-S 0.89000% 22-27.04.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 934 000	0,12	
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26*	CHF	2 930 000		2 430 000	500 000	487 250	0,03	
CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 19-01.11.28*	CHF	11 745 000		3 745 000	8 000 000	7 440 000	0,48	
CITIGROUP INC-REG-S 0.25000% 21-30.08.29*	CHF	4 500 000			4 500 000	4 072 500	0,26	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.37500% 22-29.09.26*	CHF	4 900 000			4 900 000	4 990 650	0,32	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.26250% 23-03.02.27*	CHF	7 000 000	200 000	1 400 000	5 800 000	5 884 100	0,38	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.80000% 23-03.05.28*	CHF	3 900 000			3 900 000	4 048 200	0,26	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.40000% 17-25.09.26*	CHF	985 000	2 000 000		2 985 000	2 886 495	0,18	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.11300% 19-10.12.29*	CHF	1 800 000	5 000 000		6 800 000	6 167 600	0,39	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.18750% 21-08.12.28*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 672 200	0,11	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.24000% 22-02.09.29*	CHF	2 195 000			2 195 000	2 150 003	0,14	
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.90300% 23-16.06.28*	CHF	3 000 000		3 000 000				
COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 2.48750% 23-25.01.29*	CHF	2 400 000		1 200 000	1 200 000	1 221 000	0,08	
CORNER BANCA SA 2.05000% 23-26.09.28*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 024 000	0,19	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 2.00000% 14-05.02.24*	CHF	2 155 000		2 155 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 955 000	0,13	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	1 800 000		1 800 000				
CREDIT AGRICOLE SA 0.21250% 21-21.06.29*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 560 600	0,16	
CREDIT AGRICOLE SA 0.41000% 22-18.01.30*	CHF	2 300 000		1 000 000	1 300 000	1 183 000	0,08	
CREDIT AGRICOLE SA 2.50750% 23-27.04.27*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 066 000	0,20	
CREDIT AGRICOLE SA 2.36250% 23-05.10.28*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 102 000	0,26	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.55000% 16-14.12.26*	CHF	200 000			200 000	192 600	0,01	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 19-07.11.25*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 157 100	0,14	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.12750% 20-27.07.28*	CHF	5 125 000	1 000 000		6 125 000	5 665 625	0,36	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF	4 200 000		3 200 000	1 000 000	958 500	0,06	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	2 350 000		1 000 000	1 350 000	1 194 750	0,08	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.16370% 21-28.04.28*	CHF	800 000			800 000	745 200	0,05	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 3.04250% 22-29.09.27*	CHF	3 600 000			3 600 000	3 726 000	0,24	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.19000% 22-07.12.27*	CHF	2 450 000		1 600 000	850 000	862 325	0,06	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.54130% 23-03.09.30*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 075 000	0,13	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
CREDIT AGRICOLE SA/LONDON-REG-S 0.62500% 17-12.07.24*	CHF	5 700 000			5 700 000	5 652 120	0,36	
CREDIT AGRICOLE SA/LONDON-REG-S-SUB 0.25000% 19-10.10.29*	CHF	100 000			100 000	90 800	0,01	
CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 0.55000% 16-15.04.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 987 400	0,13	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 2.45860% 23-22.11.24*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 013 800	0,19	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.45000% 17-08.11.30*	CHF	400 000			400 000	373 200	0,02	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 19-19.06.34*	CHF	500 000	2 000 000		2 500 000	2 248 750	0,14	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.10000% 21-28.01.36*	CHF	3 000 000	4 000 000		7 000 000	5 880 000	0,38	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 2.28500% 22-28.11.42*	CHF	2 880 000			2 880 000	3 211 200	0,21	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.88500% 23-13.09.35*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 557 000	0,10	
DEUTSCHE BANK AG 0.31500% 21-14.09.27*	CHF	8 000 000		2 000 000	6 000 000	5 586 000	0,36	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 15-19.12.23*	CHF	1 450 000			1 450 000	1 448 695	0,09	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25*	CHF	3 000 000		2 000 000	1 000 000	981 100	0,06	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 3.64500% 23-27.01.29*	CHF	5 400 000		1 400 000	4 000 000	4 106 000	0,26	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG-S 0.43500% 20-06.02.32*	CHF	6 000 000		2 000 000	4 000 000	3 628 000	0,23	
DNB BANK ASA 2.68500% 23-15.06.28*	CHF		2 200 000		2 200 000	2 229 700	0,14	200 000
DNB BANK ASA-REG-S 1.16750% 22-03.06.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 902 000	0,25	
DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24*	CHF	1 300 000			1 300 000	1 295 450	0,08	
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOS-REG-S 2.83250% 23-16.05.29*	CHF	5 000 000	1 000 000		6 000 000	6 162 000	0,39	
DZ BANK AG DEUTSCHE ZEN GENBK-REG-S-SUB 3.61000% 23-16.10.28*	CHF		3 800 000		3 800 000	3 891 200	0,25	
DZ BANK AG DEUTSCHE-REG-S 2.62500% 23-27.08.29*	CHF	4 400 000			4 400 000	4 470 400	0,29	
DZ BANK AG DUTSE ZENTRAL-REG-S-SUB 3.84500% 22-17.08.32*	CHF	4 400 000			4 400 000	4 540 800	0,29	
E.ON SE 1.86000% 22-05.12.25*	CHF	5 100 000			5 100 000	5 105 100	0,33	
E.ON SE 2.50250% 22-05.12.29*	CHF	5 800 000			5 800 000	6 032 000	0,39	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.55000% 17-03.09.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 979 000	0,13	200 000
ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 0.25000% 21-02.10.28*	CHF	5 100 000		2 000 000	3 100 000	2 850 450	0,18	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.07000% 19-18.10.27*	CHF	1 850 000			1 850 000	1 702 000	0,11	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23*	CHF	1 590 000		1 590 000				
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24*	CHF	2 050 000	800 000		2 850 000	2 802 975	0,18	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25*	CHF	7 200 000	3 800 000		11 000 000	10 587 500	0,68	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.06800% 21-31.03.27*	CHF	2 500 000	3 000 000		5 500 000	5 156 250	0,33	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 841 000	0,18	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 436 250	0,16	
FORD MOTOR CREDIT CO-REG-S 2.12500% 20-04.12.23*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 000 000	0,19	
FRESENIUS SE & CO KGAA 2.96000% 23-18.10.28*	CHF		3 530 000		3 530 000	3 646 490	0,23	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.50000% 17-04.12.24*	CHF	700 000			700 000	689 710	0,04	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF	1 700 000		1 700 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.40000% 21-11.05.28*	CHF	3 300 000			3 300 000	3 085 500	0,20	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 481 000	0,16	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.45000% 19-15.10.26*	CHF	10 015 000			10 015 000	9 584 355	0,61	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.32000% 21-03.11.27*	CHF	8 800 000		2 000 000	6 800 000	6 354 600	0,41	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.81250% 21-03.11.31*	CHF	7 600 000			7 600 000	6 756 400	0,43	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26*	CHF	5 800 000		2 800 000	3 000 000	2 971 500	0,19	
HYPO NOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24*	CHF	700 000			700 000	686 980	0,04	
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S-SUB 1.62500% 19-29.11.29*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 652 000	0,23	
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24*	CHF	11 000 000			11 000 000	10 805 300	0,69	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.45000% 16-11.11.26*	CHF	500 000		500 000				
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.63000% 20-25.02.35*	CHF	2 600 000			2 600 000	2 154 538	0,14	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.80000% 22-03.02.32*	CHF	8 000 000	200 000		8 200 000	7 397 531	0,47	
KOMMUNALBANKEN AVS-REG-S 1.27500% 22-22.12.27*	CHF	3 000 000		3 000 000				
LA BANQUE POSTALE SA-REG-S 2.82750% 23-12.07.30*	CHF		3 400 000		3 400 000	3 549 600	0,23	
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.60250% 23-04.10.28*	CHF		2 200 000		2 200 000	2 247 300	0,14	
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25*	CHF	2 360 000			2 360 000	2 328 140	0,15	
LLOYDS BANKING GROUP 0.60250% 22-09.02.29*	CHF	5 000 000		3 000 000	2 000 000	1 845 000	0,12	
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 2.74500% 23-02.02.27*	CHF	8 000 000			8 000 000	8 064 000	0,52	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 2.05000% 22-16.09.47*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 878 000	0,25	
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 0.39500% 21-20.07.28*	CHF	13 000 000		3 000 000	10 000 000	9 330 000	0,60	135 000
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 1.28500% 22-11.09.29*	CHF	10 750 000			10 750 000	10 325 375	0,66	
MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.65000% 23-03.05.28*	CHF	800 000			800 000	829 200	0,05	
MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24*	CHF	3 400 000			3 400 000	3 284 400	0,21	
MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL 1.96000% 23-12.10.26*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 036 000	0,26	
MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL 2.10750% 23-12.10.29*	CHF		3 900 000		3 900 000	3 995 550	0,26	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-25.09.28*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 842 000	0,12	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.15000% 22-07.12.26*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 543 750	0,23	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.30000% 17-20.12.24*	CHF	200 000		200 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.12500% 19-18.11.27*	CHF	4 500 000			4 500 000	4 209 750	0,27	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 734 300	0,11	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK-REG-S 0.40000% 22-25.02.26*	CHF	3 000 000		3 000 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 1.25000% 22-30.06.27*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 957 500	0,32	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-SUB 4.25250% 23-07.06.33*	CHF	7 000 000	200 000	600 000	6 600 000	6 849 713	0,44	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 1.75000% 23-23.06.28*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 012 500	0,06	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25000% 19-31.10.44*	CHF	800 000	200 000		1 000 000	705 360	0,05	

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 18-13.03.24*	CHF	2 150 000		2 150 000			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.12500% 19-21.06.27*	CHF	1 600 000			1 600 000	0,10	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.06500% 20-29.01.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	0,12	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.29250% 22-03.02.28*	CHF		3 000 000		3 000 000	0,18	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.71500% 23-03.02.33*	CHF	2 000 000			2 000 000	0,13	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 2.20100% 23-12.04.29*	CHF		5 000 000	3 900 000	1 100 000	0,07	
NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 1.95750% 22-03.11.27*	CHF	3 000 000			3 000 000	0,19	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.91500% 22-08.09.28*	CHF	6 000 000			6 000 000	0,38	3 800 000
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2.97000% 23-08.09.27*	CHF		2 800 000		2 800 000	0,18	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF	4 400 000		4 000 000	400 000	0,03	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.78250% 22-06.12.27*	CHF	5 400 000			5 400 000	0,35	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.85750% 23-06.06.28*	CHF	2 000 000	4 000 000		6 000 000	0,39	
NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 0.25000% 17-04.10.27*	CHF	300 000			300 000	0,02	
NORDEA BANK ABP 2.49000% 23-26.05.28*	CHF	1 400 000		400 000	1 000 000	0,07	
NORDEA BANK ABP-REG-S 0.55000% 15-23.06.25*	CHF	5 750 000			5 750 000	0,36	
NORDEA BANK ABP-REG-S 1.81000% 22-15.06.27*	CHF	5 800 000			5 800 000	0,37	
ORANGE SA-REG-S 0.20000% 19-24.11.25*	CHF	300 000		300 000			
ORANGE SA-REG-S 0.62500% 19-22.06.29*	CHF	1 800 000		1 800 000			
PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.75000% 22-02.05.29*	CHF	3 500 000	1 500 000		5 000 000	0,31	
QNB FINANCE LTD-REG-S 0.02500% 21-03.06.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	0,32	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 19-25.11.27*	CHF	8 200 000		5 200 000	3 000 000	0,18	
RABOBANK NEDERLAND NV 1.36250% 22-28.04.28*	CHF	4 800 000	1 200 000		6 000 000	0,37	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.177500% 21-15.01.27*	CHF	2 500 000			2 500 000	0,15	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.57000% 21-15.01.31*	CHF	1 500 000			1 500 000	0,09	
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26*	CHF	8 300 000			8 300 000	0,50	
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 2.63000% 23-29.06.28*	CHF		1 400 000		1 400 000	0,09	
RCI BANQUE SA-REG-S 0.50000% 19-18.07.24*	CHF		1 210 000		1 210 000	0,08	
RCI BANQUE SA-REG-S 3.50000% 23-10.05.28*	CHF	4 200 000		1 200 000	3 000 000	0,20	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.20000% 21-22.09.31*	CHF	5 000 000		600 000	4 400 000	0,25	4 400 000
ROYAL BANK OF CANADA DN-REG-S 0.25000% 21-15.10.29*	CHF	1 500 000			1 500 000		
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.49500% 22-08.07.25*	CHF	6 000 000		6 000 000			
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.44500% 23-25.01.28*	CHF	3 100 000	1 500 000		4 600 000	0,30	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.08500% 23-31.03.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	0,20	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.15000% 19-10.12.24*	CHF	4 900 000		2 000 000	2 900 000	0,18	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.73250% 23-04.07.25*	CHF		6 100 000	3 000 000	3 100 000	0,20	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.93250% 23-04.07.28*	CHF		6 500 000	970 000	5 530 000	0,37	
SANTANDER UK PLC-REG-S 2.01000% 23-12.09.26*	CHF		2 000 000		2 000 000	0,13	
SANTANDER UK PLC-REG-S 2.00500% 23-12.09.29*	CHF		3 100 000		3 100 000	0,20	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF	3 000 000			3 000 000	0,18	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 2.78250% 23-23.05.25*	CHF		1 000 000		1 000 000	0,06	
SITEX PROPERTIES AG 0.37500% 20-17.06.25*	CHF	2 500 000			2 500 000	0,16	
SOCIETE GENERALE 0.37500% 21-26.07.28*	CHF	2 600 000	2 800 000	2 000 000	3 400 000	0,20	
SOCIETE GENERALE SA 2.27750% 23-27.02.26*	CHF	5 000 000	400 000	4 800 000	600 000	0,04	
SOCIETE GENERALE SA 2.61750% 23-27.02.30*	CHF	2 400 000			2 400 000	0,16	
SOCIETE GENERALE SA 2.68250% 23-19.10.29*	CHF		5 800 000		5 800 000	0,38	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 19-08.10.26*	CHF	5 400 000			5 400 000	0,33	800 000
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 20-25.02.27*	CHF	6 400 000		2 000 000	4 400 000	0,26	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.74500% 22-26.01.29*	CHF	3 800 000			3 800 000	0,22	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.62500% 22-14.10.26*	CHF	3 000 000		2 600 000	400 000	0,03	
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.70000% 18-26.02.25*	CHF	3 200 000		2 800 000	400 000	0,03	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 19-11.12.25*	CHF	550 000			550 000	0,03	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 21-15.09.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	0,12	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 2.70000% 23-20.03.29*	CHF	4 000 000			4 000 000	0,26	
SWEDBANK AB 2.77250% 23-13.06.28*	CHF	3 600 000			3 600 000	0,23	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.35000% 19-06.03.29*	CHF	130 000			130 000	0,01	
SWISS REINSURANCE CO LTD-REG-S 0.75000% 15-21.01.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	0,25	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 1.62500% 14-01.11.24*	CHF	2 980 000			2 980 000	0,19	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 2.12500% 14-01.11.29*	CHF	300 000			300 000	0,02	215 000
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 21-16.08.23*	CHF	5 000 000		5 000 000			
THE TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 2.20250% 23-31.01.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	0,19	
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.97000% 23-18.09.26*	CHF		4 000 000		4 000 000	0,26	
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.94500% 23-18.09.29*	CHF		3 000 000		3 000 000	0,20	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.50000% 15-01.06.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	0,06	360 000
TOYOTA MOTOR FINAN NETHERLANDS BV-REG-S 2.13000% 23-15.06.27*	CHF		1 355 000		1 355 000	0,09	
TOYOTA MOTOR FINANCE NLD 2.12000% 23-26.10.29*	CHF		3 795 000		3 795 000	0,25	100 000
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.000001% 21-21.05.24*	CHF	4 000 000			4 000 000	0,25	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 0.65000% 16-02.11.26*	CHF	2 850 000		1 000 000	1 850 000	0,11	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 1.00000% 18-08.12.25*	CHF	3 290 000			3 290 000	0,21	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 0.87500% 21-19.11.31*	CHF	9 000 000		3 000 000	6 000 000	0,35	
UBS AG LONDON BRANCH-REG-S 0.15000% 21-29.06.28*	CHF	7 200 000	3 000 000	400 000	9 800 000	0,58	
UBS AG, LONDON BRANCH-REG-S 2.33000% 22-14.11.25*	CHF	3 000 000		2 000 000	1 000 000	0,06	
UBS AG/LONDON-REG-S 2.38500% 23-09.05.25*	CHF	1 500 000			1 500 000	0,10	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
UBS AG/LONDON-REG-S 2.55000% 23-09.05.29*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 551 750	0,10	
UBS GROUP AG-REG-S 0.87500% 19-30.01.25*	CHF	1 200 000		1 200 000				
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	2 800 000		1 800 000	1 000 000	972 500	0,06	
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.25000% 19-29.01.27*	CHF		1 905 000	1 905 000				
WOODSIDE FINANCE LTD-REG-S 1.00000% 16-11.12.23*	CHF	900 000			900 000	899 730	0,06	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 0.10000% 20-27.08.32*	CHF	4 500 000			4 500 000	3 908 250	0,25	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 1.12500% 22-04.07.29*	CHF	6 000 000		3 000 000	3 000 000	2 953 500	0,19	
TOTAL CHF						756 565 603	48,39	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						756 565 603	48,39	

Medium-Term Notes, Nullcoupon

CHF

CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 21-27.01.33*	CHF	1 000 000			1 000 000	829 640	0,05	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 0.00000% 21-26.08.31*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 744 000	0,11	
TOTAL CHF						2 573 640	0,16	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon						2 573 640	0,16	

Anleihen, fester Zins

CHF

ABB LTD 1.96500% 23-22.09.26*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 040 000	0,26	
ABB LTD 1.97750% 23-22.09.28*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 074 000	0,26	
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.40000% 17-20.09.27*	CHF	70 000			70 000	66 220	0,00	
ALLREAL HOLDING AG 0.62500% 16-10.05.24*	CHF	800 000			800 000	794 240	0,05	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 1.37500% 15-31.03.25*	CHF	150 000			150 000	148 245	0,01	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-19.06.26*	CHF	50 000			50 000	48 425	0,00	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.60000% 21-15.07.30*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 706 000	0,17	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.87500% 17-25.10.24*	CHF	1 930 000			1 930 000	1 901 243	0,12	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.50000% 19-12.11.25*	CHF	2 250 000			2 250 000	2 178 000	0,14	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.25000% 21-27.10.23*	CHF	2 500 000		2 500 000				
AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 20-12.02.24*	CHF	5 565 000			5 565 000	5 541 071	0,35	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.73000% 23-04.09.26*	CHF		3 500 000		3 500 000	3 531 500	0,23	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.20000% 23-22.11.27*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 019 500	0,19	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.40000% 23-22.11.30*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 024 500	0,07	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.25000% 17-22.09.25*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 140 600	0,14	
AXPO HOLDING AG 1.00200% 20-23.07.27*	CHF	800 000			800 000	769 200	0,05	
AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 194 240	0,20	3 200 000
AXPO HOLDING AG-REG-S 3.12500% 10-26.02.25*	CHF	7 370 000			7 370 000	7 458 440	0,48	
BALOISE-HOLDING AG 2.35000% 23-02.05.33*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 117 000	0,20	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26*	CHF	9 200 000		2 200 000	7 000 000	6 664 000	0,43	
BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24*	CHF	9 580 000			9 580 000	9 330 920	0,60	
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	1 610 000			1 610 000	1 607 907	0,10	
BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 2.87000% 22-03.10.25*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 034 000	0,26	
BANK JULIUS BAER & CO AG-REG-S 0.12500% 21-27.04.28*	CHF	2 000 000		2 000 000				
BANK OF MONTREAL 2.03750% 23-27.04.28*	CHF	3 400 000			3 400 000	3 468 000	0,22	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.73250% 22-25.04.29*	CHF	700 000			700 000	668 500	0,04	
BANQUE CANTONALE DE GENEVE-SUB 1.12500% 17-28.06.27*	CHF	240 000			240 000	232 800	0,01	
BANQUE CANTONALE VAUDOISE 0.40000% 16-07.04.31*	CHF	150 000			150 000	135 675	0,01	
BANQUE CANTONALE VAUDOISE 0.25000% 17-28.11.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	970 000	0,06	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.60000% 22-13.05.32*	CHF	5 000 000		2 000 000	3 000 000	2 988 000	0,19	100 000
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.87500% 23-28.03.25*	CHF	5 000 000		5 000 000				
BASLER KANTONALBANK 0.12500% 20-10.09.32*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 445 800	0,16	
BASLER KANTONALBANK 2.10000% 23-03.05.33*	CHF	4 600 000			4 600 000	4 781 700	0,31	
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.75000% 18-01.02.28*	CHF	1 500 000		1 500 000				
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S 0.10000% 19-30.09.39*	CHF	80 000			80 000	59 513	0,00	
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23*	CHF	1 960 000		1 960 000				
BOBST GROUP SA-REG-S 1.12500% 18-27.09.24*	CHF	100 000			100 000	98 650	0,01	
BOBST GROUP SA-REG-S 0.50000% 20-17.02.26*	CHF	2 515 000			2 515 000	2 447 095	0,16	
BUEHLER HOLDING AG-REG-S 0.60000% 17-21.12.26*	CHF	200 000			200 000	193 100	0,01	
CA AUTO FINANCE SUISSE SA-REG-S 2.90250% 23-20.07.26*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 039 000	0,19	10 000
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM-REG-S 1.91000% 23-14.07.28*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 028 000	0,13	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE-REG-S 1.71250% 22-13.07.27*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 020 000	0,32	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.18000% 16-05.10.23*	CHF	700 000		700 000				
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.37500% 17-27.06.25*	CHF	200 000			200 000	195 000	0,01	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.25000% 17-23.05.24*	CHF	5 200 000			5 200 000	5 153 200	0,33	215 000
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.28500% 19-19.08.27*	CHF	150 000			150 000	140 775	0,01	150 000
CEMBRA MONEY BANK AG 2.53850% 23-05.04.29*	CHF		8 000 000		8 000 000	8 204 000	0,52	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.87500% 18-08.06.26*	CHF	250 000			250 000	244 250	0,02	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.41750% 21-15.11.28*	CHF	8 920 000		4 000 000	4 920 000	4 551 000	0,29	1 390 000

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
CLARIANT AG-REG-S 2.12500% 14-17.10.24*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 990 000	0,26	
CLARIANT AG-REG-S 2.75000% 23-22.09.28*	CHF		6 000 000		6 000 000	6 114 000	0,39	1 910 000
COCA-COLA CO/THE-REG-S 1.00000% 15-02.10.28*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 474 500	0,09	
COMET HOLDING AG-REG-S 1.30000% 21-20.04.26*	CHF	985 000			985 000	961 360	0,06	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.87500% 15-31.07.24*	CHF	2 000 000		2 000 000				
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26*	CHF	800 000			800 000	773 600	0,05	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.75000% 18-06.06.25*	CHF	200 000			200 000	196 400	0,01	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.30000% 17-07.04.25*	CHF	495 000		495 000				
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.12500% 21-09.04.31*	CHF	800 000			800 000	704 800	0,05	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 1.87500% 22-29.06.26*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 002 500	0,32	
DAETWYLER HOLDING AG-REG-S 0.62500% 18-30.05.24*	CHF	250 000			250 000	248 175	0,02	
DANSKE BANK A/S-REG-S 1.86500% 23-04.10.30*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 047 000	0,13	
DBS BANK LTD-REG-S 1.51500% 22-12.12.25*	CHF	2 900 000			2 900 000	2 888 400	0,18	
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23*	CHF	4 200 000		4 200 000				
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.20000% 21-15.12.26*	CHF	9 865 000			9 865 000	9 287 898	0,59	
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.55000% 21-16.04.29*	CHF	6 250 000			6 250 000	5 659 375	0,36	
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 1.70000% 22-30.03.27*	CHF	4 555 000			4 555 000	4 468 455	0,29	
DORMAKABA FINANCE AG-REG-S 1.00000% 17-13.10.25*	CHF	200 000			200 000	196 000	0,01	
DORMAKABA FINANCE AG-REG-S 3.75000% 22-14.10.27*	CHF	4 000 000	6 000 000		10 000 000	10 475 000	0,67	
DUFROY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26*	CHF	3 400 000	150 000		3 550 000	3 481 663	0,22	
DZ BANK AG DEUTSCHE-REG-S 2.20250% 23-18.09.28*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 056 000	0,26	
EMBOTELLADORA ANDINA SA-REG-S 2.71750% 23-20.09.28*	CHF		6 100 000		6 100 000	6 191 500	0,40	
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.87500% 18-18.10.23*	CHF	3 600 000		3 600 000				
EMISSIONS- UND FINANZ AG-REG-S 0.37500% 21-06.05.26*	CHF	1 870 000			1 870 000	1 789 590	0,11	
EMMI FINANZ AG-REG-S 0.50000% 17-21.06.29*	CHF	150 000			150 000	141 450	0,01	
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.10000% 19-23.10.23*	CHF	4 000 000		4 000 000				
FERRING HOLDING SA-REG-S 1.05000% 20-09.07.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 940 000	0,19	
FERRING HOLDING SA-REG-S 3.25000% 23-21.04.31*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 194 000	0,27	
FERRING HOLDING SA-REG-S 3.25000% 23-21.04.31*	CHF		4 000 000	4 000 000				
FIRMENICH INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 20-19.12.23*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 497 550	0,22	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.55600% 21-03.09.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 877 000	0,12	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.79500% 21-01.12.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 766 000	0,11	
GALENICA AG-REG-S 2.35000% 23-08.11.29*	CHF	3 750 000			3 750 000	3 853 125	0,25	
GEBERIT AG 0.75000% 22-29.09.27*	CHF	1 300 000			1 300 000	1 262 950	0,08	
GEBERIT AG 1.50000% 22-14.09.26*	CHF	3 500 000		3 500 000				
GEBERIT AG-REG-S 0.10000% 19-17.10.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
GEBERIT AG-REG-S 2.25000% 23-26.09.25*	CHF	3 335 000		3 335 000				
GEBERIT AG-REG-S 2.30000% 23-27.09.32*	CHF	4 165 000			4 165 000	4 377 415	0,28	170 000
GEORG FISCHER LTD-REG-S 0.95000% 20-25.03.30*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 014 400	0,19	
GIVAUDAN FINANCE SA-REG-S 0.12500% 21-07.06.27*	CHF	1 935 000			1 935 000	1 831 478	0,12	
GIVAUDAN SA-REG-S 0.37500% 18-09.04.25*	CHF	3 000 000		3 000 000				
GIVAUDAN SA-REG-S 0.15000% 20-10.11.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	934 500	0,06	985 000
GIVAUDAN SA-REG-S 1.12500% 22-15.06.26*	CHF	1 750 000		1 750 000				
GIVAUDAN SA-REG-S 1.62500% 22-15.06.29*	CHF	2 220 000			2 220 000	2 231 100	0,14	
GRANDE DIXENCE SA 2.35000% 23-06.06.30*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 541 250	0,10	
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 1.12500% 17-04.07.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	993 600	0,06	
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 0.30000% 21-31.08.28*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 255 000	0,21	
GZO AG SPITAL WETZIKON-REG-S 1.87500% 14-12.06.24*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 484 000	0,16	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-REG-S 1.50000% 14-28.04.25*	CHF	450 000			450 000	448 155	0,03	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 16-04.07.23*	CHF	5 000 000		5 000 000				
HILTI AG-REG-S 0.05000% 20-02.07.25*	CHF	5 000 000		2 000 000	3 000 000	2 919 000	0,19	
HILTI AG-REG-S 0.40000% 17-08.11.27*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 048 300	0,07	
HYPOTHEKENBANK FRANKFURT INTL-REG-S 2.50000% 05-29.08.25*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 530 000	0,16	1 500 000
JULIUS BAER GROUP-REG-S 0.37500% 17-06.12.24*	CHF	300 000			300 000	294 780	0,02	
KANTONSPITAL AARAU AG-REG-S 0.70000% 18-23.05.28*	CHF	820 000			820 000	795 400	0,05	80 000
KANTONSPITAL AARAU AG-REG-S 1.10000% 18-23.05.33*	CHF	150 000			150 000	141 075	0,01	
KAZAKHSTAN TEMIR ZHO NATI CO JSC-REG-S 3.25000% 18-05.12.23*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 182 000	0,08	
KERNKRAFTWERK GOESGEN-DAENIKEN-REG-S 0.93000% 20-30.09.27*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 328 500	0,21	
KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG-REG-S 1.50000% 18-07.08.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 972 500	0,32	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.75000% 11-09.06.23*	CHF	250 000		250 000				
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 1.25000% 14-11.09.24*	CHF	200 000			200 000	198 600	0,01	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.35000% 23-01.03.27*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 045 000	0,19	2 305 000
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.75000% 23-01.03.30*	CHF	6 020 000			6 020 000	6 281 870	0,40	
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 0.70000% 17-30.01.26*	CHF	400 000			400 000	390 800	0,02	
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 0.12500% 21-21.02.31*	CHF	565 000			565 000	495 505	0,03	
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.20000% 19-18.06.25*	CHF	3 640 000			3 640 000	3 552 640	0,23	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 1.00000% 18-11.12.24*	CHF	3 000 000		3 000 000				
LIMECO-REG-S 0.37500% 18-25.09.26*	CHF	100 000			100 000	96 100	0,01	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG-S 0.30000% 17-06.10.27*	CHF	400 000		400 000				
LLOYDS BANK PLC-REG-S 1.87000% 23-31.08.27*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 037 500	0,19	
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 2.10000% 23-12.09.29*	CHF	11 400 000			11 400 000	11 565 300	0,74	
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.87500% 21-14.05.31*	CHF	3 200 000			3 200 000	2 862 400	0,18	

Titel	31.5.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.11.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon
							Anzahl/ Nominal
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 2.0000% 23-19.11.38*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 135 000	0,20	500 000
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-20.03.26*	CHF	200 000		200 000	194 500	0,01	
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.87500% 18-02.10.23*	CHF	3 000 000	3 000 000				
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 20-23.03.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 782 500	0,18	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 20-18.09.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 793 000	0,18	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.75000% 14-18.07.24*	CHF	250 000		250 000	249 125	0,02	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.25000% 20-25.06.27*	CHF	5 255 000		5 255 000	5 149 900	0,33	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 0.87500% 20-23.05.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	943 500	0,06	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.52030% 22-17.12.29*	CHF	6 300 000		6 300 000	6 303 150	0,40	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.75750% 23-23.01.26*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 000 000	0,19	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 2.01250% 23-23.01.30*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 100 000	0,26	
NESTLE SA 1.62500% 22-07.11.25*	CHF	5 000 000		5 000 000	5 010 000	0,32	
NESTLE SA 2.12500% 23-28.06.38*	CHF		9 000 000	9 000 000	9 576 000	0,61	
NESTLE SA-REG-S 1.62500% 22-15.07.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 003 500	0,06	
NESTLE SA-REG-S 2.50000% 22-14.07.34*	CHF	10 125 000		10 125 000	11 036 250	0,71	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.20000% 20-28.11.28*	CHF	310 000		310 000	290 315	0,02	
NOVARTIS AG-REG-S 0.62500% 15-13.11.29*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 378 750	0,15	
NOVARTIS AG-REG-S 1.05000% 15-11.05.35*	CHF	1 000 000		1 000 000	941 000	0,06	230 000
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.37500% 21-27.11.25*	CHF	4 755 000		4 755 000	4 550 535	0,29	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.80000% 21-27.11.28*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 813 900	0,12	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 3.25000% 23-02.10.29*	CHF	5 000 000		5 000 000	5 102 500	0,33	
OC OERLIKON CORP INC,PFAEFF-REG-S 2.87500% 23-02.06.26*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 010 000	0,26	
PARTNERS GROUP HOLDING AG-REG-S 0.15000% 17-07.06.24*	CHF	350 000		350 000	346 325	0,02	
PARTNERS GROUP HOLDING AG-REG-S 0.40000% 19-21.06.27*	CHF	2 860 000		2 860 000	2 724 150	0,17	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZ HYPO INST-REG-S 0.37500% 16-23.09.43*	CHF	100 000		100 000	79 600	0,01	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 20-22.06.40*	CHF	1 000 000		1 000 000	839 900	0,05	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.02000% 20-30.01.40*	CHF	500 000		500 000	389 000	0,02	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.20000% 20-22.05.42*	CHF	175 000		175 000	136 938	0,01	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.50000% 16-16.02.24*	CHF	200 000		200 000	199 400	0,01	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.37500% 16-29.04.26*	CHF	200 000		200 000	193 100	0,01	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.20000% 21-04.02.31*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 743 620	0,11	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.75000% 16-22.04.31*	CHF	150 000		150 000	137 925	0,01	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.50000% 20-11.11.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	929 500	0,06	1 000 000
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 1.50000% 20-23.11.34*	CHF	2 800 000		2 800 000	2 524 200	0,16	2 800 000
RIETER HOLDING AG-REG-S 1.55000% 20-17.09.24*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 977 500	0,19	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.45000% 17-23.03.29*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 851 500	0,18	400 000
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.75000% 18-24.09.30*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 430 250	0,09	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.75000% 22-25.02.31*	CHF	6 000 000		6 000 000	5 700 000	0,36	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 1.00000% 22-25.02.37*	CHF	100 000		100 000	93 100	0,01	
ROCHE KAPITALMARKT AG 1.95000% 23-15.09.38*	CHF		10 000 000	10 000 000	10 322 600	0,66	
SANDOZ GROUP AG-REG-S 2.12500% 23-17.11.26*	CHF		4 100 000	4 100 000	4 163 550	0,27	
SEE-SPITAL-REG-S 1.25000% 18-03.07.26*	CHF	350 000		350 000	338 100	0,02	
SGS SA-REG-S 0.75000% 18-29.10.25*	CHF		4 755 000	4 755 000	4 664 655	0,30	
SGS SA-REG-S 0.87500% 15-08.05.30*	CHF	1 350 000		1 350 000	1 275 075	0,08	25 000
SGS SA-REG-S 0.95000% 20-06.11.26*	CHF	860 000		860 000	839 790	0,05	
SGS SA-REG-S 1.25000% 22-05.09.25*	CHF	4 500 000	4 500 000				
SGS SA-REG-S 1.70000% 22-05.09.29*	CHF	4 500 000		4 500 000	4 484 250	0,29	
SIKA AG 2.12500% 23-11.10.24*	CHF	10 000 000	10 000 000				
SIX GROUP AG-REG-S 0.20000% 21-28.09.29*	CHF	4 515 000	3 515 000	1 000 000	923 000	0,06	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.75000% 20-06.10.28*	CHF	4 220 000		4 220 000	4 040 650	0,26	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.05000% 22-19.02.29*	CHF	1 660 000		1 660 000	1 598 580	0,10	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.40000% 22-19.02.32*	CHF	3 375 000		3 375 000	3 273 750	0,21	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.95000% 22-12.12.30*	CHF	4 800 000		4 800 000	4 874 400	0,31	
SPITAL MAENNEDORF AG-REG-S 0.95000% 18-12.12.23*	CHF	500 000		500 000	498 800	0,03	
ST GALLER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	150 000		150 000	146 250	0,01	150 000
STADLER RAIL AG-REG-S 0.37500% 19-20.11.26*	CHF	4 520 000		4 520 000	4 355 020	0,28	
STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-03.10.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 953 000	0,12	
SULZER AG 0.87500% 16-10.07.26*	CHF	200 000		200 000	194 100	0,01	
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF	4 200 000	4 200 000				
SULZER AG-REG-S 1.60000% 18-22.10.24*	CHF	3 200 000		3 200 000	3 184 320	0,20	
SULZER AG-REG-S 3.35000% 22-16.11.26*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 581 250	0,17	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.82500% 17-11.05.26*	CHF	800 000		800 000	780 800	0,05	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24*	CHF	3 900 000		3 900 000	3 873 090	0,25	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 765 800	0,11	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 19-30.09.31*	CHF	2 200 000		2 200 000	1 917 300	0,12	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.65000% 20-18.12.29*	CHF	7 465 000		7 465 000	6 905 125	0,44	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 21-11.02.28*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 352 500	0,15	
SWISSCOM AG 0.13000% 20-18.09.31*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 703 000	0,17	
SWISSCOM AG-REG-S 0.37500% 16-31.03.28*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 145 400	0,07	
SWISSCOM AG-REG-S 0.12500% 16-15.09.32*	CHF	200 000		200 000	175 700	0,01	50 000

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
SWISSCOM AG-REG-S 0.375000% 17-31.05.27*	CHF	4 450 000		1 450 000	3 000 000	2 887 500	0,18	675 000
SWISSCOM AG-REG-S 0.750000% 17-24.11.33*	CHF	1 900 000			1 900 000	1 741 350	0,11	
SWISSCOM AG-REG-S 0.500000% 19-15.03.29*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 423 500	0,09	
SWISSCOM AG-REG-S 0.750000% 18-12.10.28*	CHF	1 600 000			1 600 000	1 552 800	0,10	
SWISSCOM AG-REG-S 0.250000% 21-18.05.33*	CHF	785 000			785 000	688 838	0,04	340 000
SWISSCOM AG-REG-S 1.500000% 14-28.09.29*	CHF	100 000			100 000	100 000	0,01	
SWISSCOM AG-REG-S 1.000000% 15-17.04.35*	CHF	2 655 000			2 655 000	2 471 805	0,16	
SWISSGRID AG-REG-S 0.200000% 20-30.06.32*	CHF	500 000			500 000	440 250	0,03	
SWISSGRID AG-REG-S 0.125000% 20-30.06.36*	CHF	1 000 000			1 000 000	805 000	0,05	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.700000% 20-09.12.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 923 000	0,12	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.250000% 20-16.10.23*	CHF	2 350 000		2 350 000				
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.625000% 21-30.08.24*	CHF	6 000 000			6 000 000	5 902 800	0,38	
TEMENOS AG-REG-S 1.500000% 19-28.11.25*	CHF	2 300 000			2 300 000	2 272 400	0,15	760 000
TEMENOS AG-REG-S 1.875000% 18-30.11.23*	CHF	800 000		800 000				
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.000000% 16-28.07.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	960 000	0,06	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.166000% 19-21.12.29*	CHF	2 000 000		2 000 000				
TRANSPOWER NEW ZEALAND LTD 0.020000% 19-16.12.27*	CHF	2 050 000			2 050 000	1 901 375	0,12	
UBS GROUP AG 0.375000% 21-24.08.29*	CHF	4 800 000			4 800 000	4 358 400	0,28	
UBS GROUP AG-REG-S 1.250000% 16-23.02.26*	CHF	4 200 000		3 400 000	800 000	788 400	0,05	
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 1.820000% 23-18.10.26*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 022 500	0,32	
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 2.035000% 23-18.10.33*	CHF		8 000 000		8 000 000	8 256 000	0,53	
UNION BANCAIRE PRIVEE UBPA-REG-S 0.200000% 21-15.12.26*	CHF	4 150 000			4 150 000	3 948 725	0,25	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.555000% 21-24.03.31*	CHF	3 800 000			3 800 000	3 469 400	0,22	
VISECA PAYMENT SERVICES AG 2.250000% 23-27.10.26*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 075 000	0,32	
VP BANK AG-REG-S 0.600000% 19-29.11.29*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 283 800	0,08	
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.802500% 22-21.09.29*	CHF		2 100 000		2 100 000	2 125 200	0,14	
WESTPAC BANKING CORP 2.012500% 23-13.06.30*	CHF	2 000 000	4 200 000		6 200 000	6 382 900	0,41	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.050000% 16-23.11.26*	CHF	2 900 000		2 900 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.050000% 20-05.02.31*	CHF	4 200 000		4 200 000				
ZUG ESTATES HOLDING AG-REG-S 0.100000% 19-02.10.25*	CHF	200 000			200 000	193 600	0,01	
ZURICH INSURANCE CO-REG-S 1.000000% 18-30.10.28*	CHF	480 000			480 000	469 200	0,03	
TOTAL CHF						513 272 796	32,83	
Total Anleihen, fester Zins						513 272 796	32,83	

Anleihen, Nullcoupon

CHF

AMAG LEASING AG-REG-S 0.000000% 21-18.02.25*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 459 200	0,09	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.000000% 19-25.09.26*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 144 800	0,07	
LIECHTENSTEINISCHE LANDESBANK AG-REG-S 0.000000% 19-27.09.29*	CHF	150 000			150 000	134 400	0,01	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.000000% 19-06.02.30*	CHF	1 850 000			1 850 000	1 631 453	0,10	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.000000% 19-11.10.29*	CHF	50 000			50 000	45 750	0,00	
SWISSCOM AG-REG-S 0.000000% 19-30.08.44*	CHF	1 150 000			1 150 000	810 865	0,05	
SWISSGRID AG-REG-S 0.000000% 20-30.06.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	930 000	0,06	
TOTAL CHF						6 156 468	0,39	
Total Anleihen, Nullcoupon						6 156 468	0,39	

Anleihen, variabler Zins

CHF

BALOISE LIFE LTD-SUB 1.750%/VAR 17-PRP*	CHF	7 145 000		7 145 000				
BANK CLER AG-SUB 3.000%/VAR 20-PRP*	CHF	2 750 000			2 750 000	2 239 875	0,14	
BASLER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.875%/VAR 20-PRP*	CHF	2 175 000			2 175 000	1 902 038	0,12	1 000 000
GLARNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 611 000	0,10	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF	5 050 000	50 000		5 100 000	4 834 800	0,31	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERU-REG-S-SUB 1.450%/VAR 20-12.08.40*	CHF	875 000			875 000	782 688	0,05	
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FIN-REG-S-SUB 3.500%/VAR 18-PRP*	CHF	4 700 000			4 700 000	4 692 010	0,30	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF	2 665 000	175 000		2 840 000	2 016 400	0,13	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-PRP*	CHF	5 300 000	100 000		5 400 000	4 981 500	0,32	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF	4 685 000			4 685 000	4 614 725	0,30	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-25.09.48*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 940 000	0,12	
SWISS LIFE AG-SUB 4.375000%/VAR 16-24.09.46*	CHF	800 000			800 000	820 410	0,05	
ZUERCHER KANTONALBANK-SUB 2.125%/VAR 17-PRP*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 977 000	0,13	
TOTAL CHF						32 412 445	2,07	
Total Anleihen, variabler Zins						32 412 445	2,07	

Titel		31.5.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.11.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
Wandellanleihen, variabler Zins								
CHF								
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 1.800%/VAR 19-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	792 400	0,05	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S-SUB 3.125%/VAR 19-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	803 520	0,05	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB COCO 1.700%/VAR 17-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	966 940	0,06	1 000 000
TOTAL CHF						2 562 860	0,16	
Total Wandellanleihen, variabler Zins						2 562 860	0,16	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 538 535 273	98,41	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Global								
UBS (CH) MONEY MARKET FUND - CHF I-X**	CHF	8 500	42 000	50 495	5	4 446	0,00	
TOTAL Global						4 446	0,00	
Total Investmentzertifikate, open end						4 446	0,00	

Anleihen, fester Zins

CHF								
UBS AG/LONDON 0.71000% 22-13.04.25**	CHF	2 000 000			2 000 000	1 963 880	0,13	
TOTAL CHF						1 963 880	0,13	
Total Anleihen, fester Zins						1 963 880	0,13	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						1 968 326	0,13	

Nicht-Effekten

Treasury-Bills, Nullcoupon

CHF								
SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 14.09.23-14.12.23**	CHF		15 000 000	6 000 000	9 000 000	8 995 452	0,57	
TOTAL CHF						8 995 452	0,57	
Total Treasury-Bills, Nullcoupon						8 995 452	0,57	
Total Nicht-Effekten						8 995 452	0,57	
Total Wertschriften						1 549 499 051	99,11	
(davon ausgeliehen)						36 641 450	2,34	
Bankguthaben auf Sicht						3 275 248	0,21	
Derivative Finanzinstrumente						-75 760	0,00	
Sonstige Vermögenswerte						10 690 618	0,68	
Gesamtfondsvermögen						1 563 389 157	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-17 634 778		
Andere Verbindlichkeiten						-240 148		
Nettofondsvermögen						1 545 514 231		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.11.2023	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 538 535 273	98,41
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	10 888 018	0,70
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
TOTAL	1 549 423 291	99,11

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/ Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 2.10000% 23-10.03.25**	288 500 000	CHF	35 000 000	-407 638	-0.03
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-10.03.25	288 500 000	CHF			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 2.05750% 23-09.03.25**	262 000 000	CHF	34 000 000	-368 026	-0.01
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-09.03.25	262 000 000	CHF			
			69 000 000	-775 664	-0.04

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
UBS/INTEREST RATE SWAP REC 2.03000% 23-03.03.38**	8 000 000	CHF	8 000 000	699 904	0.04
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY SARON O/N 23-03.03.38	8 000 000	CHF			
			8 000 000	699 904	0.04

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.49250% 23-15.03.25	CHF	35 000 000	35 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-15.03.25	CHF	35 000 000	35 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
UBS/INTEREST RATE SWAP REC 2.03000% 23-03.03.38	CHF	8 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY SARON O/N 23-03.03.38	CHF	8 000 000

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission:
Klasse F: 0,18% p.a.;
 - Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
Klasse F: 0,30% p.a.;
- berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der AMAS in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:
Klasse F: 0,19%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 2% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Bewertungs-Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert.

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 0.95 USD 1 = CHF 0.87

UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable

Art Effektenfonds

Wichtigste Daten

	ISIN	30.11.2023	31.5.2023	31.5.2022
Nettofondsvermögen in CHF		2 291 734 337.87	2 325 390 441.43	2 162 868 926.93
Klasse I-X	CH0540307235			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		92.13	90.05	90.55
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		92.48	89.85	90.42
Anzahl Anteile im Umlauf		975 367,2560	481 651,8840	455 530,3340
Klasse P	CH0002791843			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		113.43	110.47	111.30
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		113.86	110.23	111.14
Anzahl Anteile im Umlauf		526 183,7920	548 616,5970	603 899,4470
Klasse Q	CH0203279580			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		91.70	89.41	89.87
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		92.05	89.21	89.74
Anzahl Anteile im Umlauf		26 476,8710	27 078,4280	34 622,5940
Klasse U-X	CH0111018120			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		9 445.92	9 232.73	9 281.98
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		9 481.81	9 212.42	9 268.99
Anzahl Anteile im Umlauf		226 527,7520	240 339,5240	220 998,0000

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

Schweiz	56,09
Kanada	7,58
Deutschland	7,30
Frankreich	5,27
Grossbritannien	4,39
Vereinigte Staaten von Amerika	3,63
Australien	2,61
Supranational	1,89
Spanien	1,52
Österreich	1,44
Übrige	7,66
TOTAL	99,38

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.11.2023	31.5.2023
Verkehrswerte	CHF	CHF
Bankguthaben		
– auf Sicht	1 255 031.13 ¹	2 852 070.33 ²
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2 282 434 421.78	2 310 792 411.11
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	4 445.70	27 349 130.00
Derivative Finanzinstrumente	-1 181 789.00	668 659.20
Sonstige Vermögenswerte	14 292 101.40	12 707 561.95
Gesamtfondsvermögen	2 296 804 211.01	2 354 369 832.59
Aufgenommene Kredite	-5 022 262.45	-28 933 753.55
Andere Verbindlichkeiten	-47 610.69	-45 637.61
Nettofondsvermögen	2 291 734 337.87	2 325 390 441.43

Erfolgsrechnung

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
Ertrag	CHF	CHF
Erträge der Bankguthaben	62 711.22	21 569.74
Negativzinsen	-14 896.45	-86 363.38
Erträge der Geldmarktinstrumente	32 000.00	28 620.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	11 313 582.77	16 430 951.52
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	555 692.56	1 289 173.36
Erträge der Effektenleihe	127 607.12	197 146.24
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	430 865.88	1 476 133.50
TOTAL Ertrag	12 507 563.10	19 357 230.98
Aufwand		
Passivzinsen	-6 732.13	-19 705.36
Prüfaufwand	0.00	-16 300.40
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X	0.00	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P	-270 410.78	-566 014.27
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q	-5 955.64	-13 975.85
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse U-X	0.00	0.00
Sonstige Aufwendungen	-3 202.75	-5 511.75
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-787 795.86	-187 257.11
TOTAL Aufwand	-1 074 097.16	-808 764.74
Nettoertrag	11 433 465.94	18 548 466.24
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ³	-22 459 242.38	-25 892 791.21
Realisierter Erfolg	-11 025 776.44	-7 344 324.97
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	80 565 128.11	14 786 060.28
Gesamterfolg	69 539 351.67	7 441 735.31

¹ Zum 30. November 2023 wurden gegenüber UBS AG in Höhe von CHF 1 140 000.00 als Sicherheiten hinterlegt.

² Zum 31. Mai 2023 wurden gegenüber UBS AG in Höhe von CHF 490 000.00 als Sicherheiten hinterlegt.

³ Realisierte Kapitalgewinne und -verluste können Aufwendungen und Erträge aus Swinging Single Pricing enthalten.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	2 325 390 441.43	2 162 868 926.93
Ordentliche Jahresausschüttung	0.00	-14 650 290.11
Abgeführte Verrechnungssteuer	-18 497 637.11	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-84 697 818.12	169 730 069.30
Gesamterfolg	69 539 351.67	7 441 735.31
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	2 291 734 337.87	2 325 390 441.43

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	481 651,8840	455 530,3340
Ausgegebene Anteile	530 514,8930	32 874,5890
Zurückgenommene Anteile	-36 799,5210	-6 753,0390
Bestand Ende Berichtsperiode	975 367,2560	481 651,8840
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	493 715,3720	26 121,5500
Klasse P		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	548 616,5970	603 899,4470
Ausgegebene Anteile	7 669,3380	3 031,0710
Zurückgenommene Anteile	-30 102,1430	-58 313,9210
Bestand Ende Berichtsperiode	526 183,7920	548 616,5970
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-22 432,8050	-55 282,8500
Klasse Q		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	27 078,4280	34 622,5940
Ausgegebene Anteile	3 790,7590	64,0000
Zurückgenommene Anteile	-4 392,3160	-7 608,1660
Bestand Ende Berichtsperiode	26 476,8710	27 078,4280
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-601,5570	-7 544,1660
Klasse U-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	240 339,5240	220 998,0000
Ausgegebene Anteile	3 418,2280	28 097,5240
Zurückgenommene Anteile	-17 230,0000	-8 756,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	226 527,7520	240 339,5240
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-13 811,7720	19 341,5240

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
AUTO LEASE-NOW 2023-2 AG-REG-S STEP-UP/DOWN 23-22.02.33*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 045 109	0,13
SWISS AUTO LEASE GMBH-REG-S STEP-UP 20-23.03.30*	CHF	100 000			100 000	99 213	0,00
SWISS CAR ABS 2020-1 AG-REG-S STEP-UP 20-18.08.30*	CHF	1 500 000		1 500 000			
SWISS CAR ABS-REG-S STEP-UP/DOWN 21-18.04.31*	CHF	2 330 000			2 330 000	2 314 059	0,10
SWISSCARD AECS GMBH-REG-S 0.35000% 21-15.06.26*	CHF	2 530 000			2 530 000	2 500 957	0,11
TOTAL CHF						7 959 338	0,35
Total Asset Backed Securities, fester Zins						7 959 338	0,35

Notes, fester Zins

CHF							
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.87500% 15-23.01.30*	CHF	2 950 000			2 950 000	2 826 100	0,12
ABB LTD 2.11250% 23-22.09.33*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 073 000	0,09
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.95000% 21-25.03.31*	CHF	1 165 000			1 165 000	1 076 460	0,05
AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEILIG-REG-S 1.45000% 20-23.07.27*	CHF	3 885 000			3 885 000	3 749 025	0,16
AMAG LEASING AG-REG-S 3.01250% 23-04.09.29*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 525 500	0,07
AXPO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 22-04.02.25*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 427 200	0,15
AXPO HOLDING AG-REG-S 2.00000% 22-15.09.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 501 250	0,11
AXPO HOLDING AG-REG-S 2.50000% 23-22.09.26*	CHF		7 500 000		7 500 000	7 586 250	0,33
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF-REG-S 1.50000% 13-26.06.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 027 000	0,13
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.25000% 20-02.09.32*	CHF	900 000			900 000	796 950	0,03
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.85000% 22-21.01.32*	CHF	5 300 000			5 300 000	4 658 700	0,20
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.18000% 21-20.04.29*	CHF	15 650 000		7 650 000	8 000 000	7 280 000	0,32
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 2.41130% 23-08.08.29*	CHF	3 500 000		300 000	3 200 000	3 257 600	0,14
CLARIANT AG-REG-S 2.71700% 22-24.09.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 054 000	0,18
EBN BV-REG-S 0.87500% 14-22.09.26*	CHF	170 000		170 000			
EQUINIX EUR 1 FINANCING CORP LLC-REG-S 2.87500% 23-12.09.28*	CHF		3 135 000		3 135 000	3 238 455	0,14
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.46000% 23-18.07.33*	CHF		7 200 000		7 200 000	7 304 400	0,32
FLUGHAFEN ZURICH AG-REG-S 0.10000% 20-30.12.27*	CHF	500 000		500 000			
GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.62500% 14-30.07.29*	CHF	800 000			800 000	815 200	0,04
GIVAUDAN FINANCE SA 0.37500% 21-07.06.30*	CHF	200 000			200 000	183 100	0,01
GLARNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.00000% 21-28.07.31*	CHF	2 180 000			2 180 000	1 971 810	0,09
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.10000% 21-07.12.29*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 742 000	0,12
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.05000% 19-09.10.23*	CHF	2 000 000		2 000 000			
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.25000% 21-14.02.25*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 119 040	0,14
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF	3 850 000			3 850 000	3 764 145	0,16
LANDESBK HESSEN-THUERIN GIROZ-REG-S-SUB 4.24250% 23-25.07.33*	CHF		5 200 000		5 200 000	5 454 800	0,24
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF	4 280 000			4 280 000	4 128 060	0,18
LONZA SWISS FINANZ AG 2.60000% 23-16.05.31*	CHF		5 200 000		5 200 000	5 408 000	0,24
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 2.12500% 11-04.10.41*	CHF	500 000			500 000	534 000	0,02
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 434 750	0,06
NESTLE SA 1.87500% 23-20.11.31*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 085 500	0,13
NESTLE SA 2.00000% 23-20.11.36*	CHF		3 500 000		3 500 000	3 668 000	0,16
NESTLE SA-REG-S 2.00000% 23-28.06.33*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 192 500	0,23
NESTLE SA-REG-S 2.12500% 22-15.07.30*	CHF	4 800 000			4 800 000	5 001 600	0,22
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF-REG-S 0.12500% 19-06.12.32*	CHF	200 000			200 000	176 000	0,01
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.25000% 15-30.04.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	978 900	0,04
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 12-14.02.40*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 975 000	0,09
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 12-20.09.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 990 200	0,09
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 15-21.01.30*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 807 100	0,12
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 15-05.05.28*	CHF	4 500 000		2 500 000	2 000 000	1 919 000	0,08
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 19-15.04.30*	CHF	11 465 000		5 000 000	6 465 000	5 983 358	0,26
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 19-26.04.34*	CHF	850 000			850 000	741 625	0,03
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-13.08.27*	CHF	2 500 000		2 500 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 20-15.03.41*	CHF	15 000 000			15 000 000	11 952 000	0,52
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-17.08.40*	CHF	12 090 000			12 090 000	9 464 052	0,41
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPO INST-REG-S 0.12500% 20-14.10.33*	CHF	3 000 000		320 000	2 680 000	2 324 900	0,10
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 21-24.01.41*	CHF	3 300 000			3 300 000	2 634 060	0,11
PFANDBRIEFBK SCHZ HYPO INST-REG-S 1.00000% 18-23.01.43*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 525 500	0,20
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.15000% 20-02.02.29*	CHF	500 000			500 000	457 500	0,02

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.50000% 22-25.02.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 882 000	0,17	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 2.00000% 22-23.09.32*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 174 000	0,18	500 000
ROCHE KAPITALMARKT AG 1.75000% 23-15.09.33*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 037 080	0,09	
SANDOZ GROUP AG-REG-S 2.60000% 23-17.11.31*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 135 000	0,14	
SGS SA-REG-S 2.00000% 23-17.11.27*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 027 000	0,13	
SGS SA-REG-S 2.30000% 23-17.11.31*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 068 000	0,09	
SIKA AG 2.25000% 23-13.04.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 050 000	0,09	
SIKA AG-REG-S 2.35000% 22-28.11.28*	CHF	4 280 000			4 280 000	4 401 980	0,19	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.50000% 20-06.10.25*	CHF	7 645 000	35 000	2 680 000	5 000 000	4 885 000	0,21	
SULZER AG 0.87500% 20-18.11.27*	CHF	7 425 000		2 000 000	5 000 000	5 202 575	0,23	3 470 000
SULZER AG-REG-S 0.80000% 20-23.09.25*	CHF	5 510 000			5 510 000	5 394 290	0,23	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.25880% 23-26.07.28*	CHF	2 295 000		2 295 000				
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.61000% 23-26.01.32*	CHF	720 000			720 000	761 760	0,03	
SWISSCOM AG-REG-S 1.75000% 12-10.07.24*	CHF	2 480 000		2 480 000				
SWISSCOM AG-REG-S 1.87500% 23-23.08.30*	CHF	3 335 000			3 335 000	3 406 703	0,15	
SWISSGRID AG-REG-S 1.90000% 23-30.06.26*	CHF		1 485 000		1 485 000	1 492 425	0,06	
TECAN GROUP AG-REG-S 0.05000% 21-06.10.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 904 000	0,13	
TRANSPower NEW ZEALAND LTD 0.03750% 21-16.03.29*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 781 000	0,12	
UBS GROUP AG-REG-S 0.43500% 21-09.11.28*	CHF	8 000 000	1 400 000	4 400 000	5 000 000	4 615 000	0,20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.19250% 21-24.03.28*	CHF	1 200 000	1 800 000		3 000 000	2 802 000	0,12	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 2.05000% 23-24.07.28*	CHF	5 000 000		1 000 000	4 000 000	4 086 000	0,18	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 21-21.10.31*	CHF	7 500 000			7 500 000	6 671 250	0,29	
ZUERCHER KANTONALBANK 1.40000% 22-25.07.29*	CHF	1 875 000			1 875 000	1 864 688	0,08	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.75000% 23-19.04.28*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 092 000	0,18	
TOTAL CHF						228 547 340	9,95	
Total Notes, fester Zins						228 547 340	9,95	

Notes, Nullcoupon

CHF								
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.10.30*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 382 500	0,19	
RHAETISCHE BAHN STAMM 0.00000% 21-29.09.36*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 668 000	0,07	
TOTAL CHF						6 050 500	0,26	
Total Notes, Nullcoupon						6 050 500	0,26	

Notes, variabler Zins

CHF								
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-30.09.41*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 604 000	0,16	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 1.500%/VAR 22-03.05.52*	CHF	17 000 000			17 000 000	15 002 500	0,65	
TOTAL CHF						18 606 500	0,81	
Total Notes, variabler Zins						18 606 500	0,81	

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF								
ABN AMRO BANK NV 2.50500% 23-26.06.28*	CHF		4 000 000	2 000 000	2 000 000	2 058 000	0,09	
ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.62500% 23-02.03.28*	CHF	5 000 000		1 000 000	4 000 000	4 064 000	0,18	
ACHMEA BANK NV-REG-S 0.50000% 17-03.10.25*	CHF	200 000		200 000				
ACHMEA BANK NV-REG-S 2.74750% 23-16.10.30*	CHF		800 000		800 000	815 600	0,04	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.72500% 18-15.02.24*	CHF	1 290 000			1 290 000	1 284 711	0,06	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24*	CHF	1 655 000			1 655 000	1 621 900	0,07	
ADECCO SA-REG-S 0.87500% 20-27.11.25*	CHF	8 000 000			8 000 000	7 860 000	0,34	100 000
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.30000% 17-08.10.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	934 500	0,04	
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.65000% 18-08.02.44*	CHF	180 000			180 000	148 500	0,01	
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 1.99250% 23-14.03.33*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 109 500	0,14	
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 1.84250% 23-15.06.35*	CHF		6 000 000		6 000 000	6 120 000	0,27	
ALBERTA, PROVINCE OF-REG-S 0.37500% 19-07.02.29*	CHF	500 000			500 000	473 750	0,02	500 000
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF	955 000		955 000				
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF	2 300 000	2 250 000		4 550 000	4 244 240	0,18	
ASB BANK LTD-REG-S 0.20000% 17-02.08.24*	CHF	840 000				840 000		
ASB BANK LTD-REG-S 0.45000% 19-30.01.25*	CHF	4 000 000			4 000 000			
ASB BANK LTD-REG-S 0.11750% 21-29.06.28*	CHF	6 000 000		1 000 000	5 000 000	4 615 000	0,20	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.40750% 22-28.11.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 030 000	0,13	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.77000% 22-28.11.28*	CHF	3 000 000		400 000	2 600 000	2 702 700	0,12	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S-SUB 1.60000% 17-24.05.27*	CHF		2 400 000		2 400 000	2 327 652	0,10	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24*	CHF	1 245 000			1 245 000	1 223 960	0,05	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	940 500	0,04	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF	1 760 000			1 760 000	1 660 560	0,07	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	980 200	0,04	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.32750% 22-10.06.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	991 500	0,04	
BANK FUER ARBEIT UN WIRTSCHAFT AG 2.05250% 23-14.04.28*	CHF	10 500 000			10 500 000	10 647 000	0,46	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF	4 060 000		4 060 000				
BANK OF MONTREAL-REG-S 2.26000% 23-01.02.29*	CHF	4 000 000		2 000 000	2 000 000	2 036 000	0,09	
BANK OF NEW ZEALAND 0.362500% 21-14.12.29*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 275 400	0,06	
BANK OF NOVA SCOTIA DN-REG-S 0.14250% 21-25.10.28*	CHF	8 300 000		5 500 000	2 800 000	2 573 200	0,11	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.20000% 18-19.11.25*	CHF	125 000			125 000	121 500	0,01	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.30250% 21-30.07.31*	CHF	4 300 000		2 300 000	2 000 000	1 755 000	0,08	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.38500% 22-01.02.29*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 235 750	0,14	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 0.27800% 22-01.04.27*	CHF	5 700 000			5 700 000	5 460 600	0,24	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.04250% 23-04.05.26*	CHF	16 000 000			16 000 000	16 160 000	0,70	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE 2.14250% 23-03.05.30*	CHF	5 500 000			5 500 000	5 673 250	0,25	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.38250% 23-22.09.27*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 084 000	0,18	
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 20-03.11.28*	CHF		2 070 000		2 070 000	1 905 435	0,08	
BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL-REG-S 2.73000% 23-11.07.30*	CHF		4 300 000		4 300 000	4 499 950	0,20	
BANQUE FEDERTIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.30000% 23-30.01.27*	CHF	4 000 000		1 000 000	3 000 000	3 051 000	0,13	
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S 1.000000% 19-10.07.25*	CHF	600 000			600 000	585 600	0,03	
BARCLAYS PLC-REG-S 0.31500% 21-04.06.27*	CHF	6 000 000		1 000 000	5 000 000	4 705 000	0,20	
BARCLAYS PLC-REG-S 1.12500% 18-12.07.23*	CHF	2 200 000			2 200 000			
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.37500% 18-23.03.26*	CHF	380 000		380 000				
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK-REG-S 0.37500% 19-13.05.30*	CHF	11 500 000			11 500 000	10 631 750	0,46	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.05000% 20-28.01.31*	CHF	11 000 000			11 000 000	9 845 000	0,43	
BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WI-REG-S 2.95500% 22-29.11.27*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 038 000	0,09	
BAWAG PSK BK FR ARBEIT WIRT O-REG-S 1.58500% 23-16.12.26*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 984 000	0,17	
BERLIN HYP AG 0.25000% 21-04.10.29*	CHF	8 400 000		6 400 000	2 000 000	1 817 000	0,08	
BERLIN HYP AG 2.25000% 23-08.11.27*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 028 000	0,09	
BERLIN HYP AG-REG-S 0.25000% 20-11.09.28*	CHF	4 500 000		2 000 000	2 500 000	2 308 750	0,10	
BERLIN HYP AG-REG-S 0.96750% 22-04.08.26*	CHF	3 800 000			3 800 000	3 739 200	0,16	
BERLIN-HANNOVERSCHE HYPOTHEKBNK-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	8 000 000		2 000 000	6 000 000	5 259 000	0,23	
BKW AG-REG-S 0.25000% 19-29.07.27*	CHF	150 000			150 000	142 650	0,01	
BNG BANK NV 1.68750% 23-19.05.30*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 867 200	0,12	
BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28*	CHF	4 400 000			4 400 000	4 118 400	0,18	
BNP PARIBAS SA 2.41250% 23-13.01.28*	CHF	6 000 000		2 400 000	3 600 000	3 684 600	0,16	
BNP PARIBAS SA 2.89250% 22-27.09.29*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 281 400	0,10	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.30000% 19-15.10.27*	CHF	2 000 000		2 000 000				
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.15000% 20-10.03.28*	CHF	7 600 000	2 000 000	2 600 000	7 000 000	6 454 000	0,28	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.14750% 21-13.07.27*	CHF	6 000 000		3 200 000	2 800 000	2 620 800	0,11	
BNP PARIBAS SA-REG-S 2.63000% 23-07.06.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 073 700	0,09	
BNP PARIBAS-REG-S 0.50000% 21-16.03.29*	CHF	6 000 000			6 000 000	5 478 000	0,24	
BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25*	CHF	1 750 000		1 750 000				
BNP PARIBAS-SUB 1.75000% 15-05.06.25*	CHF	1 105 000			1 105 000	1 097 265	0,05	
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.11100% 20-24.07.28*	CHF	2 500 000	90 000		2 590 000	2 387 980	0,10	
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF	2 000 000		2 000 000				
CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.75000% 23-24.02.31*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 031 000	0,09	
CAIXABANK SA-REG-S 0.47700% 21-01.07.27*	CHF	4 200 000			4 200 000	3 960 600	0,17	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAD-REG-S 0.12500% 15-22.12.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	969 500	0,04	
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.05000% 19-15.10.26*	CHF	975 000			975 000	928 688	0,04	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.10000% 18-30.04.25*	CHF	3 110 000			3 110 000	3 037 848	0,13	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.60000% 19-30.01.25*	CHF	1 305 000		1 305 000				
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.28250% 22-03.02.27*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 708 200	0,07	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.96750% 22-26.04.29*	CHF	10 700 000			10 700 000	10 400 400	0,45	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF	870 000		870 000				
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24*	CHF	5 700 000			5 700 000	5 605 950	0,24	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF	6 300 000			6 300 000	6 243 300	0,27	
CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 944 000	0,08	
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 0.77500% 20-18.02.27*	CHF	2 640 000			2 640 000	2 530 440	0,11	
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.11750% 20-17.07.25*	CHF	3 000 000	85 000		3 085 000	3 004 790	0,13	
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.17000% 21-29.09.31*	CHF	3 450 000			3 450 000	2 939 400	0,13	250 000
CIE DE FINANCIER FONCIER SA-REG-S 0.89000% 22-27.04.29*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 835 000	0,21	
CIE DE FINANCIER FONCIER SA 1.83750% 23-18.07.30*	CHF		1 300 000		1 300 000	1 323 400	0,06	
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26*	CHF	1 000 000		1 000 000				
CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 19-01.11.28*	CHF	3 000 000		3 000 000				
CITIGROUP INC-REG-S 0.25000% 21-30.08.29*	CHF	8 000 000		8 000 000				
CNTRL AMRCAN BANK FOR ECO INTGTIN REG-S 1.54620% 22-30.11.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	989 500	0,04	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.37500% 22-29.09.26*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 074 000	0,18	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.26250% 23-03.02.27*	CHF	5 000 000		1 400 000	3 600 000	3 652 200	0,16	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.80000% 23-03.05.28*	CHF	4 800 000			4 800 000	4 982 400	0,22	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.40000% 17-25.09.26*	CHF	2 940 000		2 940 000				
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.11300% 19-10.12.29*	CHF		50 000		50 000	45 350	0,00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.18750% 21-08.12.28*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 043 800	0,09	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.15750% 21-08.12.31*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 772 000	0,08	

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.24000% 22-02.09.29*	CHF	7 000 000			6 856 500	0,30	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.94000% 23-26.06.30*	CHF		4 800 000		4 915 200	0,21	
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.90300% 23-16.06.28*	CHF	11 000 000			11 187 000	0,49	
CORNER BANCA SA 2.05000% 23-26.09.28*	CHF		3 000 000		3 024 000	0,13	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.50000% 14-01.12.28*	CHF	9 440 000		200 000	8 948 940	0,39	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.50000% 15-26.02.26*	CHF	1 000 000			966 000	0,04	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25*	CHF	2 250 000			2 199 375	0,10	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	2 440 000		2 440 000			
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.50000% 15-16.03.27*	CHF	1 715 000			1 660 120	0,07	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 15-18.06.26*	CHF	1 340 000			1 293 770	0,06	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 18-08.12.25*	CHF	340 000			330 140	0,01	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.50000% 18-03.10.28*	CHF	1 215 000			1 156 073	0,05	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 19-24.10.29*	CHF	2 000 000			1 849 669	0,08	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.82500% 23-26.05.28*	CHF	8 000 000			8 124 000	0,35	
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.03000% 21-24.09.31*	CHF	3 000 000			2 598 000	0,11	
CREDIT AGRICOLE NEXT BANK SU SA-REG-S 1.93200% 23-23.09.30*	CHF		4 375 000		4 469 063	0,19	
CREDIT AGRICOLE SA 0.21250% 21-21.06.29*	CHF	2 000 000			1 829 000	0,08	
CREDIT AGRICOLE SA 0.41000% 22-18.01.30*	CHF	1 200 000	3 000 000		3 822 000	0,17	
CREDIT AGRICOLE SA 2.50750% 23-27.04.27*	CHF	2 000 000			2 044 000	0,09	
CREDIT AGRICOLE SA 2.36250% 23-05.10.28*	CHF		4 000 000		4 102 000	0,18	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	415 000		415 000			
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 19-07.11.25*	CHF	2 400 000			2 353 200	0,10	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.12750% 20-27.07.28*	CHF	3 730 000	80 000	3 810 000			
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF	3 800 000		1 800 000	1 917 000	0,08	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	2 300 000		1 000 000	1 150 500	0,05	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.16370% 21-28.04.28*	CHF	500 000			465 750	0,02	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 3.04250% 22-29.09.27*	CHF	2 000 000			2 070 000	0,09	
CREDIT AGRICOLE SAVLONDON-SUB 2.12500% 15-29.09.25*	CHF	1 000 000			1 002 500	0,04	
CREDIT AGRICOLE SAVLONDON-REG-S 0.62500% 17-12.07.24*	CHF	1 500 000		1 500 000			
CREDIT AGRICOLE SAVLONDON-REG-S-SUB 0.25000% 19-10.10.29*	CHF	3 320 000	40 000	2 000 000	1 360 000	1 234 880	0,05
CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 0.55000% 16-15.04.24*	CHF	600 000			600 000	596 220	0,03
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 2.45860% 23-22.11.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 023 000	0,22
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.45000% 17-08.11.30*	CHF	1 350 000			1 350 000	1 259 550	0,05
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 19-19.06.34*	CHF	345 000			345 000	310 328	0,01
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.20000% 21-20.05.33*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 764 000	0,08
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.10000% 21-28.01.36*	CHF	3 500 000			3 500 000	2 940 000	0,13
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.88500% 23-13.09.35*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 076 000	0,09
DEUTSCHE BANK AG 0.31500% 21-14.09.27*	CHF	7 800 000		2 800 000	5 000 000	4 655 000	0,20
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 15-19.12.23*	CHF	1 900 000			1 900 000	1 898 290	0,08
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25*	CHF	200 000		200 000			
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 3.64500% 23-27.01.29*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 106 000	0,18
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG-S 0.43500% 20-06.02.32*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 721 000	0,12
DNB BANK ASA-REG-S 0.12500% 18-30.11.23*	CHF	65 000		65 000			
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
DNB BANK ASA-REG-S 1.16750% 22-03.06.27*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 951 000	0,08
DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 989 500	0,13
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOS-REG-S 2.83250% 23-16.05.29*	CHF	4 800 000	800 000		5 600 000	5 751 200	0,25
DZ BANK AG DEUTSCHE ZEN GENBK-REG-S-SUB 3.61000% 23-16.10.28*	CHF		5 800 000		5 800 000	5 939 200	0,26
DZ BANK AG DEUTSCHE-REG-S 2.62500% 23-27.08.29*	CHF	1 600 000			1 600 000	1 625 600	0,07
DZ BANK AG DUTSE ZENTRAL-REG-S-SUB 3.84500% 22-17.08.32*	CHF	6 200 000	600 000		6 800 000	7 017 600	0,31
E.ON SE 1.86000% 22-05.12.25*	CHF	3 600 000			3 600 000	3 603 600	0,16
E.ON SE 2.50250% 22-05.12.29*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 160 000	0,18
ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 0.25000% 21-02.10.28*	CHF	5 100 000		2 000 000	3 100 000	2 850 450	0,12
EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 3.12500% 06-30.06.36*	CHF	375 000			375 000	454 875	0,02
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.07000% 19-18.10.27*	CHF	3 340 000			3 340 000	3 072 800	0,13
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23*	CHF	4 820 000		4 820 000			
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24*	CHF	3 840 000			3 840 000	3 776 640	0,16
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 080 000	0,13
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.06800% 21-31.03.27*	CHF	7 000 000			7 000 000	6 562 500	0,29
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 788 000	0,16
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 949 000	0,08
FRESENIUS SE & CO KGAA 2.96000% 23-18.10.28*	CHF		5 455 000		5 455 000	5 635 015	0,25
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.50000% 17-04.12.24*	CHF	730 000		730 000			
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF	1 500 000		1 500 000			
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.40000% 21-11.05.28*	CHF	2 000 000		2 000 000			
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	5 000 000		5 000 000			
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.45000% 19-15.10.26*	CHF	4 670 000			4 670 000	4 469 190	0,19
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.32000% 21-03.11.27*	CHF	9 000 000		4 000 000	5 000 000	4 672 500	0,20
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.81250% 21-03.11.31*	CHF	7 200 000		2 000 000	5 200 000	4 622 800	0,20
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26*	CHF	4 200 000			4 200 000	4 160 100	0,18

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.12500% 19-03.09.29*	CHF	350 000			309 050	0,01	
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.50000% 22-07.04.27*	CHF	1 000 000			963 000	0,04	
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24*	CHF	15 600 000	3 000 000		12 376 980	0,54	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.63000% 20-25.02.35*	CHF	1 800 000			1 491 603	0,06	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.80000% 22-03.02.32*	CHF	5 800 000			5 232 400	0,23	
KOMMUNALBANKEN A/S-REG-S 1.27500% 22-22.12.27*	CHF	4 200 000			4 187 400	0,18	
KOMMUNALKREDIT AUSTRIA AG-REG-S 3.37500% 06-22.06.26*	CHF	370 000			380 175	0,02	
KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 0.19250% 20-15.06.25*	CHF	925 000			896 325	0,04	
LA BANQUE POSTALE SA-REG-S 2.82750% 23-12.07.30*	CHF		3 000 000		3 132 000	0,14	
LA BANQUE POSTALE-REG-S 2.77250% 23-12.07.27*	CHF		1 000 000		1 031 000	0,04	
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.60250% 23-04.10.28*	CHF		2 200 000		2 247 300	0,10	
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25*	CHF	1 180 000			1 164 070	0,05	
LLOYDS BANKING GROUP 0.60250% 22-09.02.29*	CHF	4 200 000	2 200 000		1 845 000	0,08	
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 2.74500% 23-02.02.27*	CHF	1 400 000			1 411 200	0,06	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 2.05000% 22-16.09.47*	CHF	6 500 000			7 202 000	0,31	
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 0.39500% 21-20.07.28*	CHF	5 120 000	600 000		4 217 160	0,18	
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 1.28500% 22-11.09.29*	CHF	9 300 000	1 300 000		7 684 000	0,33	
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.25000% 19-15.03.29*	CHF	2 355 000			2 212 523	0,10	
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.80000% 19-15.03.39*	CHF	650 000			581 100	0,03	
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.70000% 20-20.04.40*	CHF	170 000			145 860	0,01	
MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.65000% 23-03.05.28*	CHF	5 500 000	400 000		5 286 150	0,23	
MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24*	CHF	5 400 000	1 400 000		6 568 800	0,29	
MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL 1.96000% 23-12.10.26*	CHF		3 000 000		3 027 000	0,13	
MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL 2.10750% 23-12.10.29*	CHF		2 000 000		2 049 000	0,09	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 19-11.06.27*	CHF	4 540 000		4 540 000			
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-25.09.28*	CHF	1 500 000		400 000	1 103 100	0,04	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.15000% 21-25.09.29*	CHF	1 000 000			909 000	0,04	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.15000% 22-07.12.26*	CHF	4 500 000	400 000		4 151 250	0,18	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.30000% 17-20.12.24*	CHF	1 070 000			1 051 489	0,05	375 000
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.55000% 17-22.11.32*	CHF	1 415 000			1 296 140	0,06	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.50000% 18-14.06.28*	CHF	350 000			334 775	0,01	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 19-26.02.29*	CHF	1 300 000			1 210 950	0,05	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.20000% 19-18.06.31*	CHF	4 800 000			4 310 400	0,19	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.12500% 19-18.11.27*	CHF	1 000 000			935 500	0,04	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25*	CHF	2 000 000	2 000 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 21-29.03.41*	CHF	5 000 000			4 002 500	0,17	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.05000% 21-13.08.36*	CHF	7 500 000			6 046 500	0,26	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.12500% 21-05.10.29*	CHF	1 000 000			920 000	0,04	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.37500% 22-07.04.26*	CHF	4 900 000			4 767 700	0,21	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 1.25000% 22-30.06.27*	CHF	20 050 000			19 879 575	0,87	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 1.87500% 23-07.05.30*	CHF	2 000 000			2 035 000	0,09	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-SUB 4.25250% 23-07.06.33*	CHF	7 400 000			7 679 981	0,33	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 1.75000% 23-23.06.28*	CHF		5 000 000		5 062 500	0,22	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25000% 19-31.10.44*	CHF	1 200 000			846 432	0,04	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.12500% 19-21.06.27*	CHF	240 000	240 000				
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.71500% 23-03.02.33*	CHF	4 000 000	1 000 000		3 004 500	0,13	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 2.20100% 23-12.04.29*	CHF		4 000 000		4 102 000	0,18	
NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 1.95750% 22-03.11.27*	CHF	4 000 000			4 054 000	0,18	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.16750% 19-11.07.31*	CHF	450 000			400 725	0,02	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.91500% 22-08.09.28*	CHF	6 000 000			5 961 000	0,26	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2.97000% 23-08.09.27*	CHF		1 800 000		1 829 700	0,08	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF	3 800 000	3 000 000		800 000	788 160	0,03
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.78250% 22-06.12.27*	CHF	3 400 000			3 400 000	3 490 100	0,15
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.85750% 23-06.06.28*	CHF	2 600 000	3 000 000		5 600 000	5 759 600	0,25
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 3.25000% 06-07.08.29*	CHF	810 000			810 000	893 835	0,04
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 0.00200% 21-04.03.41*	CHF	400 000			400 000	316 400	0,01
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 20-11.09.29*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 560 000	0,20
NORDEA BANK ABP 2.49000% 23-26.05.28*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 225 800	0,05
NORDEA BANK ABP-REG-S 0.12500% 20-02.06.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	961 000	0,04
NORDEA BANK ABP-REG-S 1.81000% 22-15.06.27*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 787 400	0,12
ONTARIO, PROVINCE OF-REG-S 0.25000% 17-28.06.29*	CHF	600 000	600 000				
ONTARIO, PROVINCE OF-REG-S 0.05000% 21-12.05.33*	CHF	3 300 000			3 300 000	2 872 650	0,13
ORANGE SA-REG-S 0.20000% 19-24.11.25*	CHF	1 300 000	1 300 000				
PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 21-26.10.28*	CHF	4 000 000	800 000		3 200 000	2 924 800	0,13
PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.75000% 22-02.05.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 960 000	0,09
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZE HYPOTHEK-REG-S 1.750000% 23-09.07.38*	CHF		6 785 000		6 785 000	6 929 521	0,30
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.62500% 11-29.11.41*	CHF	120 000			120 000	121 068	0,01
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 12-27.04.27*	CHF	5 540 000	5 540 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 17-23.01.37*	CHF	2 050 000			2 050 000	1 814 455	0,08
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 17-21.12.29*	CHF	1 550 000			1 550 000	1 463 045	0,06

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 17-25.01.35*	CHF	5 250 000		5 250 000	4 721 850	0,21	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.25000% 17-12.10.27*	CHF	10 500 000	10 500 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPO INST-REG-S 0.25000% 17-18.09.26*	CHF	500 000		500 000	483 200	0,02	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 18-12.05.27*	CHF	2 250 000	2 250 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.12500% 19-08.05.29*	CHF	6 050 000		6 050 000	5 630 735	0,25	
PFANDBRIEFBK SCHWIZERI HYPHKA AG-REG-S 0.12500% 21-19.03.31*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 522 500	0,20	
QNB FINANCE LTD-REG-S 0.02500% 21-03.06.24*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 938 200	0,22	
QUEBEC, PROVINCE OF 2.04000% 23-09.05.33*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 188 000	0,18	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 19-25.11.27*	CHF	400 000		400 000	374 600	0,02	400 000
RABOBANK NEDERLAND NV 1.36250% 22-28.04.28*	CHF	3 600 000	1 600 000	2 000 000	1 946 000	0,08	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.177500% 21-15.01.27*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	951 000	0,04	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.57000% 21-15.01.31*	CHF	1 000 000		1 000 000	897 500	0,04	
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 231 100	0,05	
RCI BANQUE SA-REG-S 3.50000% 23-10.05.28*	CHF	3 100 000		3 100 000	3 239 500	0,14	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.20000% 21-22.09.31*	CHF	8 100 000	6 100 000	2 000 000	1 750 000	0,08	1 265 000
ROYAL BANK OF CANADA DN-REG-S 0.25000% 21-15.10.29*	CHF	7 850 000	4 000 000	3 850 000	3 499 650	0,15	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.40000% 22-05.10.26*	CHF	3 700 000		3 700 000	3 579 750	0,16	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.49500% 22-08.07.25*	CHF	10 200 000		10 200 000	10 159 200	0,44	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.44500% 23-25.01.28*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 066 000	0,13	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.47500% 23-30.01.26*	CHF	7 000 000		7 000 000	6 982 500	0,30	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.08500% 23-31.03.28*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 082 000	0,18	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.73250% 23-04.07.25*	CHF		4 000 000	2 000 000	2 032 000	0,09	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.93250% 23-04.07.28*	CHF		5 250 000	5 250 000	5 446 875	0,24	
SANTANDER UK PLC-REG-S 2.01000% 23-12.09.26*	CHF		3 500 000	3 500 000	3 545 500	0,15	
SANTANDER UK PLC-REG-S 2.00500% 23-12.09.29*	CHF		8 600 000	8 600 000	8 819 300	0,38	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 740 000	0,16	
SITEX PROPERTIES AG 0.37500% 20-17.06.25*	CHF	4 020 000		4 020 000	3 923 520	0,17	
SOCIETE GENERALE 0.37500% 21-26.07.28*	CHF	5 400 000	1 200 000	1 400 000	4 776 200	0,21	
SOCIETE GENERALE SA 2.27750% 23-27.02.26*	CHF	6 600 000		5 800 000	807 600	0,04	
SOCIETE GENERALE SA 2.68250% 23-19.10.29*	CHF		5 200 000	1 000 000	4 200 000	0,19	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 19-08.10.26*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 141 200	0,05	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 20-25.02.27*	CHF	6 200 000		3 200 000	2 815 500	0,12	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.74500% 22-26.01.29*	CHF	7 400 000		600 000	6 800 000	0,27	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.62500% 22-14.10.26*	CHF	2 000 000		2 000 000			
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.70000% 18-26.02.25*	CHF	1 200 000		1 200 000			
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.87500% 19-28.02.24*	CHF	400 000		400 000	398 640	0,02	
SPAREBANK 1 BOLIGKREDIT AS 1.86750% 23-23.10.28*	CHF		4 000 000	4 000 000	4 074 000	0,18	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 19-11.12.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	966 000	0,04	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 21-15.09.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	913 000	0,04	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 2.70000% 23-20.03.29*	CHF	2 400 000		2 400 000	2 444 400	0,11	
SWEDBANK AB 2.77250% 23-13.06.28*	CHF	3 200 000		3 200 000	3 257 600	0,14	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 1.62500% 14-01.11.24*	CHF	1 720 000		1 720 000	1 706 240	0,07	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 21-16.08.23*	CHF	5 000 000	5 000 000				
THE TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 2.20250% 23-31.01.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 011 000	0,04	
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.97000% 23-18.09.26*	CHF		7 000 000	7 000 000	7 073 500	0,31	
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.94500% 23-18.09.29*	CHF		9 000 000	9 000 000	9 211 500	0,40	
TOYOTA MOTOR FINANCE NLD 2.12000% 23-26.10.29*	CHF		2 840 000	2 840 000	2 913 840	0,13	
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.000001% 21-21.05.24*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 955 645	0,17	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 0.65000% 16-02.11.26*	CHF	9 200 000	5 000 000	4 200 000	4 048 800	0,18	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 1.00000% 18-08.12.25*	CHF	6 000 000		6 000 000	5 895 000	0,26	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 0.87500% 21-19.11.31*	CHF	9 000 000	5 200 000	3 800 000	3 437 100	0,15	
UBS AG LONDON BRANCH-REG-S 0.15000% 21-29.06.28*	CHF	7 900 000	3 000 000	4 900 000	4 554 550	0,20	
UBS AG, LONDON BRANCH-REG-S 0.23000% 22-14.11.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 016 000	0,09	
UBS AG/LONDON-REG-S 2.38500% 23-09.05.25*	CHF	2 000 000	4 000 000	2 000 000	4 027 200	0,18	
UBS AG/LONDON-REG-S 2.55000% 23-09.05.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 069 000	0,09	
UBS GROUP AG-REG-S 0.87500% 19-30.01.25*	CHF	3 960 000		3 800 000	158 560	0,01	
UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S 2.00000% 13-20.11.23*	CHF	200 000		200 000			
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	2 820 000		1 800 000	991 950	0,04	
VODAFONE GROUP PLC-REG-S 0.62500% 17-15.03.27*	CHF	335 000		335 000			
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.30000% 17-28.11.25*	CHF	670 000		670 000	654 925	0,03	315 000
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.25000% 19-29.01.27*	CHF		1 905 000	1 905 000	1 828 800	0,08	
WOODSIDE FINANCE LTD-REG-S 1.00000% 16-11.12.23*	CHF	2 630 000		2 630 000	2 629 211	0,11	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 1.12500% 22-04.07.29*	CHF	10 000 000	2 000 000	8 000 000	7 876 000	0,34	
TOTAL CHF					846 242 941	36,84	
Total Medium-Term Notes, fester Zins					846 242 941	36,84	

Titel		31.5.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.11.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
CHF								
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 21-27.01.33*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 074 100	0,09	
KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24*	CHF	1 200 000		1 200 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.00000% 19-11.07.25*	CHF	1 005 000			1 005 000	976 860	0,04	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-06.06.25*	CHF	1 480 000		1 480 000				
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 0.00000% 21-26.08.31*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 092 800	0,09	
TOTAL CHF						5 143 760	0,22	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon						5 143 760	0,22	

Anleihen, fester Zins

CHF								
AAREKRAFTWERK KLINGNAU AG-REG-S 0.62500% 19-03.08.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	940 500	0,04	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.60000% 12-18.05.37*	CHF	630 000			630 000	626 220	0,03	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.25000% 17-07.09.26*	CHF	305 000		305 000				
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 19-11.02.26*	CHF	500 000		500 000				
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.01000% 20-29.06.28*	CHF	1 765 000		1 765 000				
ABB LTD 1.96500% 23-22.09.26*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 040 000	0,18	
ABB LTD 1.97750% 23-22.09.28*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 055 500	0,13	
ABB LTD-REG-S 1.00000% 19-07.05.29*	CHF	300 000		300 000				
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.35000% 22-24.03.27*	CHF	5 005 000			5 005 000	4 819 815	0,21	
ALLREAL HOLDING AG 0.62500% 16-10.05.24*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 474 800	0,15	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 1.37500% 15-31.03.25*	CHF	3 605 000			3 605 000	3 562 822	0,16	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-19.06.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	968 500	0,04	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.87500% 17-25.10.24*	CHF	1 175 000			1 175 000	1 157 493	0,05	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.50000% 19-12.11.25*	CHF	1 850 000			1 850 000	1 790 800	0,08	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 20-12.02.24*	CHF	1 350 000			1 350 000	1 344 195	0,06	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.73000% 23-04.09.26*	CHF		2 500 000		2 500 000	2 522 500	0,11	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.20000% 23-22.11.27*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 032 500	0,22	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.40000% 23-22.11.30*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 024 500	0,04	
ASIAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 2.75000% 10-12.02.30*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 257 525	0,05	
AXPO HOLDING AG 1.00200% 20-23.07.27*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 442 250	0,06	
AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 794 960	0,12	2 800 000
AXPO HOLDING AG-REG-S 3.12500% 10-26.02.25*	CHF	4 600 000			4 600 000	4 655 200	0,20	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.50000% 19-28.11.25*	CHF	300 000		300 000				
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26*	CHF	13 400 000		6 000 000	7 400 000	7 044 800	0,31	
BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23*	CHF	1 330 000		1 330 000				
BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24*	CHF	3 025 000			3 025 000	2 946 350	0,13	
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	7 225 000			7 225 000	7 215 608	0,31	
BANK CLER AG-REG-S 0.50000% 17-28.11.25*	CHF	900 000			900 000	877 500	0,04	
BANK CLER AG-REG-S 0.37500% 19-26.04.27*	CHF	500 000		500 000				
BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 2.87000% 22-03.10.25*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 034 000	0,18	
BANK OF MONTREAL 2.03750% 23-27.04.28*	CHF	15 000 000			15 000 000	15 300 000	0,67	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.73250% 22-25.04.29*	CHF	5 500 000			5 500 000	5 252 500	0,23	
BANQUE CANTONALE DE GENEVE-SUB 1.12500% 17-28.06.27*	CHF	250 000			250 000	242 500	0,01	
BANQUE CANTONALE VAUDOISE-REG-S 0.20000% 21-22.12.33*	CHF	1 000 000			1 000 000	847 000	0,04	
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF-REG-S 1.37500% 14-29.09.34*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 002 000	0,17	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.01000% 21-28.01.33*	CHF	700 000			700 000	603 750	0,03	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK-REG-S 0.10000% 21-18.03.30*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 361 250	0,06	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 2.00000% 23-23.02.34*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 084 000	0,13	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.87500% 23-28.03.25*	CHF	5 000 000		3 000 000	2 000 000	2 002 200	0,09	
BASLER KANTONALBANK 1.50000% 12-02.03.27*	CHF	1 470 000			1 470 000	1 465 590	0,06	
BASLER KANTONALBANK 0.30000% 17-22.06.27*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 099 400	0,05	
BASLER KANTONALBANK 2.10000% 23-03.05.33*	CHF	10 200 000			10 200 000	10 602 900	0,46	
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 19-02.04.27*	CHF	300 000			300 000	286 500	0,01	
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 19-19.12.33*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 442 450	0,06	
BAWAG PSK BK FR ARBEIT WIRT OEST PPE AG 1.96000% 23-26.05.31*	CHF	6 600 000			6 600 000	6 751 800	0,29	
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.75000% 18-01.02.28*	CHF	250 000			250 000	238 250	0,01	
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S 0.10000% 19-30.09.39*	CHF	1 325 000			1 325 000	985 691	0,04	
BKW AG-REG-S 0.75000% 18-15.10.25*	CHF	200 000			200 000	196 300	0,01	
BKW FMB ENERGIE AG-REG-S 2.50000% 10-15.10.30*	CHF	2 470 000			2 470 000	2 572 505	0,11	
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23*	CHF	2 800 000		2 800 000				
BLS AG-REG-S 2.00000% 22-26.07.47*	CHF	4 690 000			4 690 000	5 130 860	0,22	
BOBST GROUP SA-REG-S 1.12500% 18-27.09.24*	CHF	250 000			250 000	246 625	0,01	
BOBST GROUP SA-REG-S 0.50000% 20-17.02.26*	CHF	275 000			275 000	267 575	0,01	
BUEHLER HOLDING AG-REG-S 0.60000% 17-21.12.26*	CHF	2 745 000			2 745 000	2 650 298	0,12	

Titel	31.5.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.11.2023			Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
				Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM-REG-S 1.91000% 23-14.07.28*	CHF	3 100 000		3 100 000	3 143 400	0,14	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE-REG-S 1.71250% 22-13.07.27*	CHF	10 000 000		10 000 000	10 040 000	0,44	
CANTON OF GENEVA SWITZERLAND-REG-S 0.03000% 20-28.06.30*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 592 500	0,20	
CANTON OF GENEVA SWITZERLAND-REG-S 0.20000% 20-28.09.35*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 156 250	0,09	
CANTON OF TICINO-REG-S 2.00000% 22-20.11.37*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 098 000	0,09	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.18000% 16-05.10.23*	CHF	1 550 000	1 550 000				
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.37500% 17-27.06.25*	CHF	750 000		750 000	731 250	0,03	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.25000% 17-23.05.24*	CHF	1 150 000		1 150 000	1 139 650	0,05	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.28500% 19-19.08.27*	CHF	165 000		165 000	154 853	0,01	165 000
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.15250% 19-14.10.26*	CHF	1 500 000	1 500 000				
CEMBRA MONEY BANK AG 2.53850% 23-05.04.29*	CHF	7 000 000		7 000 000	7 178 500	0,31	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.41750% 21-15.11.28*	CHF	4 420 000	1 500 000	2 920 000	2 701 000	0,12	2 920 000
CLARIANT AG-REG-S 2.12500% 14-17.10.24*	CHF	6 000 000		6 000 000	5 985 000	0,26	
CLARIANT AG-REG-S 2.75000% 23-22.09.28*	CHF	4 000 000	4 000 000	4 000 000	4 076 000	0,18	
COCA-COLA CO/THE-REG-S 1.00000% 15-02.10.28*	CHF	390 000	390 000				
COMET HOLDING AG-REG-S 1.30000% 21-20.04.26*	CHF	845 000		845 000	824 720	0,04	500 000
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.87500% 15-31.07.24*	CHF	905 000	905 000				
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	967 000	0,04	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.75000% 18-06.06.25*	CHF	350 000	350 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.30000% 17-07.04.25*	CHF	455 000		455 000	442 988	0,02	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 2.08000% 22-31.08.28*	CHF	3 350 000		3 350 000	3 350 000	0,15	
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.12500% 21-09.04.31*	CHF	5 400 000		5 400 000	4 757 400	0,21	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.25000% 20-16.06.28*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 865 000	0,08	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 1.87500% 22-29.06.26*	CHF	5 000 000		5 000 000	5 002 500	0,22	
DANSKE BANK A/S-REG-S 1.86500% 23-04.10.30*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 558 750	0,11	
DBS BANK LTD-REG-S 1.51500% 22-12.12.25*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 988 000	0,13	
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23*	CHF	1 085 000	1 085 000				
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.20000% 21-15.12.26*	CHF	6 100 000		6 100 000	5 743 150	0,25	
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.55000% 21-16.04.29*	CHF	5 700 000		5 700 000	5 161 350	0,22	
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 1.70000% 22-30.03.27*	CHF	5 265 000		5 265 000	5 164 965	0,22	
DORMAKABA FINANCE AG-REG-S 1.00000% 17-13.10.25*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 764 000	0,08	
DUFREY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26*	CHF	3 110 000		3 110 000	3 050 133	0,13	
DZ BANK AG DEUTSCHE-REG-S 2.20250% 23-18.09.28*	CHF	3 000 000	300 000	2 700 000	2 737 800	0,12	
EMBOTELLADORA ANDINA SA-REG-S 2.71750% 23-20.09.28*	CHF	3 500 000		3 500 000	3 552 500	0,15	
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.87500% 18-18.10.23*	CHF	2 240 000	2 240 000				
EMISSIONS- UND FINANZ AG-REG-S 0.37500% 21-06.05.26*	CHF	1 870 000		1 870 000	1 789 590	0,08	
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN-REG-S 2.87500% 05-04.02.30*	CHF	3 375 000		3 375 000	3 678 750	0,16	
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO-REG-S 3.00000% 06-15.05.26*	CHF	3 000 000	3 000 000				
EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.37500% 13-21.02.28*	CHF	2 635 000	2 635 000				
EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.75000% 13-28.06.33*	CHF	3 050 000		3 050 000	3 178 100	0,14	
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.10000% 19-23.10.23*	CHF	100 000	100 000				
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS DU 1.73500% 23-31.01.28*	CHF	8 000 000		8 000 000	8 044 000	0,35	
FERRING HOLDING SA-REG-S 1.05000% 20-09.07.25*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 940 000	0,13	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.57800% 19-11.03.24*	CHF	1 280 000		1 280 000	1 270 912	0,06	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.55600% 21-03.09.26*	CHF	3 200 000	100 000	3 300 000	3 097 050	0,13	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.79500% 21-01.12.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 649 000	0,12	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.25000% 19-24.05.29*	CHF	4 820 000		4 820 000	4 482 600	0,20	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.10000% 19-01.11.44*	CHF	2 800 000		2 800 000	2 032 800	0,09	
GEBERIT AG 0.75000% 22-29.09.27*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 914 500	0,13	
GEBERIT AG 1.50000% 22-14.09.26*	CHF	3 500 000	3 500 000				
GEBERIT AG-REG-S 2.25000% 23-26.09.25*	CHF	2 000 000	2 000 000				
GEBERIT AG-REG-S 2.30000% 23-27.09.32*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 627 500	0,11	
GENEVA, CANTON OF 1.50000% 12-27.01.28*	CHF	910 000		910 000	915 915	0,04	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 2.12500% 10-27.10.28*	CHF	2 270 000		2 270 000	2 359 665	0,10	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 2.00000% 11-28.11.41*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 079 000	0,05	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.50000% 12-28.05.27*	CHF	2 060 000		2 060 000	2 073 390	0,09	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.37500% 14-29.09.34*	CHF	1 000 000		1 000 000	995 500	0,04	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.50000% 15-27.11.30*	CHF	4 650 000		4 650 000	4 389 600	0,19	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.50000% 16-31.10.56*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 076 000	0,13	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.25000% 17-29.11.27*	CHF	930 000		930 000	892 335	0,04	30 000
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.50000% 17-28.11.31*	CHF	1 550 000		1 550 000	1 449 250	0,06	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.05000% 20-15.11.29*	CHF	15 000 000	4 000 000	11 000 000	10 219 000	0,44	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.25000% 20-15.06.40*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 043 750	0,09	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.05000% 21-27.08.41*	CHF	28 000 000		28 000 000	21 644 000	0,94	
GEORG FISCHER LTD-REG-S 0.95000% 20-25.03.30*	CHF	7 000 000		7 000 000	6 594 000	0,29	4 260 000
GEORGES FISCHER FINANZ AG-REG-S 0.87500% 16-12.05.26*	CHF	3 250 000		3 250 000	3 180 125	0,14	2 870 000
GIVAUDAN FINANCE SA-REG-S 0.12500% 21-07.06.27*	CHF	1 935 000	1 935 000				
GIVAUDAN SA-REG-S 0.37500% 18-09.04.25*	CHF	2 000 000	2 000 000				
GIVAUDAN SA-REG-S 0.15000% 20-10.11.28*	CHF	1 860 000		1 860 000	1 738 170	0,08	1 860 000
GIVAUDAN SA-REG-S 1.12500% 22-15.06.26*	CHF	1 250 000	1 250 000				
GIVAUDAN SA-REG-S 1.62500% 22-15.06.29*	CHF	1 780 000		1 780 000	1 788 900	0,08	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.40000% 18-30.11.26*	CHF	300 000	300 000				

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal	
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal				
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 0.30000% 21-31.08.28*	CHF	1 850 000			1 850 000	1 720 500	0,07	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK-REG-S 0.62500% 15-20.04.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	951 000	0,04	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.25000% 16-10.03.28*	CHF	4 000 000		1 000 000	3 000 000	2 833 500	0,12	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.37500% 19-28.05.32*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 524 900	0,07	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 1.80000% 22-27.05.27*	CHF	5 800 000			5 800 000	5 756 500	0,25	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-REG-S 1.50000% 14-28.04.25*	CHF	700 000			700 000	697 130	0,03	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 0.87500% 19-08.05.24*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 388 100	0,06	
HYPOTHEKENBANK FRANKFURT INTL-REG-S 2.50000% 05-29.08.25*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 048 000	0,18	
JULIUS BAER GROUP-REG-S 0.37500% 17-06.12.24*	CHF	450 000		450 000				
KANTONSSPITAL BADEN AG-REG-S 0.35000% 21-30.09.36*	CHF	3 250 000			3 250 000	2 697 500	0,12	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.75000% 11-09.06.23*	CHF	200 000		200 000				
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.87500% 11-30.06.31*	CHF	200 000			200 000	209 000	0,01	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 3.00000% 12-27.09.52*	CHF	50 000			50 000	56 250	0,00	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 3.00000% 13-02.04.48*	CHF	100 000			100 000	111 300	0,00	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.00000% 17-11.12.23*	CHF	300 000			300 000	299 970	0,01	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.75000% 23-01.03.30*	CHF	2 410 000			2 410 000	2 514 835	0,11	
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.20000% 19-18.06.25*	CHF	4 320 000		3 320 000	1 000 000	976 000	0,04	
LAUSANNE, CITY OF-REG-S 2.10000% 23-17.02.48*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 658 000	0,12	
LAUSANNE, CITY OF-REG-S 1.87500% 23-14.09.76*	CHF		500 000		500 000	601 000	0,03	
LIECHTENSTEINISCHE LANDESBANK AG-REG-S 0.12500% 19-28.05.26*	CHF	300 000			300 000	288 000	0,01	
LOYDS BANK PLC-REG-S 1.87000% 23-31.08.27*	CHF		12 400 000	400 000	12 000 000	12 150 000	0,53	
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.70000% 17-12.07.24*	CHF	2 000 000		2 000 000				
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 2.10000% 23-12.09.29*	CHF	3 400 000			3 400 000	3 449 300	0,15	
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S 1.87500% 10-26.11.35*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 117 050	0,05	1 000 000
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 2.00000% 10-06.12.33*	CHF	500 000			500 000	514 000	0,02	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 1.62500% 12-20.07.37*	CHF	510 000			510 000	502 350	0,02	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.85000% 19-12.03.42*	CHF	1 950 000			1 950 000	1 698 450	0,07	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 19-07.10.44*	CHF	6 500 000			6 500 000	4 784 000	0,21	200 000
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.87500% 21-14.05.31*	CHF	6 320 000			6 320 000	5 653 240	0,25	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 2.00000% 23-19.11.38*	CHF		5 000 000	270 000	4 730 000	4 942 850	0,22	
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 1.87500% 14-16.09.24*	CHF	1 150 000		1 150 000				
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-20.03.26*	CHF	3 155 000			3 155 000	3 068 238	0,13	1 750 000
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.87500% 18-02.10.23*	CHF	8 650 000		8 650 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 20-18.09.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 793 000	0,12	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 2.37500% 13-15.02.28*	CHF	200 000		200 000				
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.75000% 14-18.07.24*	CHF	200 000			200 000	199 300	0,01	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 2.00000% 16-02.02.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 005 000	0,04	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.55000% 18-19.08.25*	CHF	250 000			250 000	248 250	0,01	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.25000% 20-25.06.27*	CHF	435 000		435 000				
NANT DE DRANCE SA-REG-S 0.87500% 20-23.05.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 887 000	0,08	1 365 000
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.30000% 17-31.10.25*	CHF	510 000		510 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.52030% 22-17.12.29*	CHF	7 750 000			7 750 000	7 753 875	0,34	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.75750% 23-23.01.26*	CHF	6 400 000			6 400 000	6 400 000	0,28	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 2.01250% 23-23.01.30*	CHF	10 000 000			10 000 000	10 250 000	0,45	
NESTLE SA 1.62500% 22-07.11.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 010 000	0,22	
NESTLE SA 2.12500% 23-28.06.38*	CHF		6 000 000		6 000 000	6 384 000	0,28	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF-REG-S 0.20000% 16-07.11.31*	CHF	2 100 000			2 100 000	1 888 950	0,08	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF-REG-S 0.25000% 17-19.01.29*	CHF	1 470 000		1 470 000				
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.20000% 20-28.11.28*	CHF	195 000			195 000	182 618	0,01	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.55000% 20-27.05.33*	CHF	1 000 000			1 000 000	904 000	0,04	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 2.62500% 14-17.06.24*	CHF	1 300 000			1 300 000	1 300 000	0,06	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.37500% 21-27.11.25*	CHF	4 800 000			4 800 000	4 593 600	0,20	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 3.25000% 23-02.10.29*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 571 750	0,16	
OC OERLIKON CORP INC, PFAEFF-REG-S 2.87500% 23-02.06.26*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 508 750	0,15	
ORIOR AG-REG-S 0.62500% 17-26.09.23*	CHF	7 700 000		7 700 000				
PARTNERS GROUP HOLDING AG-REG-S 0.15000% 17-07.06.24*	CHF	3 250 000		3 250 000				
PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 1.87500% 10-15.09.31*	CHF	6 640 000			6 640 000	6 815 960	0,30	
PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 2.12500% 10-01.12.28*	CHF	2 490 000			2 490 000	2 570 925	0,11	
PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 2.62500% 11-14.02.31*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 462 000	0,28	
PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 2.25000% 10-13.08.32*	CHF	8 905 000			8 905 000	9 422 381	0,41	
PFANDBREFZENTR SCHWEZ KANTNALBNKN-REG-S 2.00000% 10-30.10.25*	CHF	9 050 000		9 050 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER AG-REG-S 0.25000% 21-25.04.42*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 581 600	0,07	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HY-REG-S 1.75000% 23-23.12.43*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 228 000	0,23	
PFANDBRIEFBK SCHWCHER HYPO INST-REG-S 0.12500% 21-20.06.31*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 702 700	0,12	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 2.37500% 11-27.06.25*	CHF	8 685 000		8 685 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 12-21.01.28*	CHF	4 040 000		4 040 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 12-02.08.33*	CHF	4 200 000			4 200 000	4 176 480	0,18	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 12-13.08.27*	CHF	3 020 000		3 020 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.62500% 13-03.07.30*	CHF	4 060 000			4 060 000	4 096 134	0,18	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 2.12500% 14-03.03.44*	CHF	300 000			300 000	333 150	0,01	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 14-15.12.25*	CHF	8 000 000		8 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.00000% 14-07.07.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 468 750	0,11	

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 14-09.11.35*	CHF	6 600 000		6 600 000	6 523 440	0,28	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 14-05.12.40*	CHF	1 650 000		1 650 000	1 628 055	0,07	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 15-25.04.33*	CHF	8 850 000		8 850 000	8 128 725	0,35	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 15-25.01.34*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 275 500	0,10	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.87500% 15-25.06.37*	CHF	2 250 000		2 250 000	2 054 250	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 15-24.01.25*	CHF	3 450 000	3 450 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.00000% 15-12.05.32*	CHF	1 850 000		1 850 000	1 771 560	0,08	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 15-26.01.26*	CHF	9 200 000	9 200 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 15-16.05.31*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 875 200	0,08	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 15-15.10.25*	CHF	2 800 000	2 800 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.00000% 15-25.01.36*	CHF	10 000 000		10 000 000	9 354 000	0,41	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 15-15.06.29*	CHF	8 500 000		8 500 000	8 068 200	0,35	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 15-28.11.34*	CHF	1 250 000		1 250 000	1 142 375	0,05	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER-REG-S 0.25000% 16-05.08.26*	CHF	4 160 000	4 160 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 16-06.09.28*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 408 950	0,06	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 16-05.10.35*	CHF	3 225 000		3 225 000	2 837 033	0,12	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.12500% 16-15.12.27*	CHF	2 250 000	2 250 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPO INST-REG-S 0.37500% 16-08.07.39*	CHF	3 550 000		3 550 000	2 948 275	0,13	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPO INST-REG-S 0.25000% 16-04.08.38*	CHF	1 550 000		1 550 000	1 281 075	0,06	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPO INST-REG-S 0.12500% 16-15.07.31*	CHF	1 000 000		1 000 000	899 900	0,04	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.37500% 16-15.06.46*	CHF	450 000		450 000	348 570	0,02	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZ HYPO INST-REG-S 0.37500% 16-23.09.43*	CHF	2 245 000		2 245 000	1 787 020	0,08	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 16-14.10.36*	CHF	340 000		340 000	286 450	0,01	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 17-06.05.25*	CHF	1 000 000	1 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 17-21.03.28*	CHF	2 250 000		2 250 000	2 149 875	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-18.01.27*	CHF	1 500 000	1 500 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-27.04.26*	CHF	2 420 000	2 420 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 18-17.11.25*	CHF	6 000 000	6 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERIS HYP INST-REG-S 0.50000% 18-22.01.29*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 620 100	0,07	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.87500% 19-15.03.40*	CHF	50 000		50 000	44 835	0,00	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 19-10.12.30*	CHF	10 000 000		10 000 000	9 085 000	0,40	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-17.06.41*	CHF	1 200 000		1 200 000	999 360	0,04	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-25.01.44*	CHF	900 000		900 000	734 040	0,03	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 20-22.06.40*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 679 800	0,07	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-07.06.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 827 200	0,12	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 20-06.10.42*	CHF	18 745 000		18 745 000	14 669 837	0,64	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-02.08.30*	CHF	7 500 000		7 500 000	6 852 000	0,30	20 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-19.11.32*	CHF	7 700 000		7 700 000	6 779 850	0,30	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 21-21.12.35*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 565 000	0,11	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 21-19.12.31*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 468 500	0,19	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 22-09.04.32*	CHF	2 405 000		2 405 000	2 376 140	0,10	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 2.25000% 22-05.07.52*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 932 500	0,13	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 2.00000% 23-02.04.38*	CHF	14 920 000		14 920 000	15 792 820	0,69	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.75000% 23-24.03.43*	CHF	2 000 000	2 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWISCHER HYPO INST-REG-S 0.25000% 17-20.10.26*	CHF	2 600 000	2 600 000				
PFANDBRIEFBK SCHWZERSHR HYPO INST-REG-S 2.50000% 11-30.03.26*	CHF	1 000 000	1 000 000				
PFANDBRIEFZEN SCHWEIZ KANTONAL-REG-S AG 0.25000% 17-01.12.25*	CHF	160 000		160 000	155 904	0,01	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.62500% 11-31.10.24*	CHF	80 000		80 000	79 864	0,00	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALB-REG-S 1.62500% 12-17.04.28*	CHF	1 070 000	1 070 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.50000% 12-21.05.29*	CHF	820 000		820 000	821 886	0,04	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTNLBKN-REG-S 1.37500% 13-05.11.27*	CHF	3 840 000	3 840 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KAN BAN-REG-S 1.50000% 13-21.06.28*	CHF	1 980 000	1 980 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.62500% 14-17.06.26*	CHF	2 500 000	2 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.50000% 14-05.02.29*	CHF	2 950 000	2 950 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.00000% 14-22.09.28*	CHF	1 200 000	1 200 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.62500% 15-12.02.30*	CHF	3 890 000	3 890 000		3 695 500	0,16	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTOBANK-REG-S 0.62500% 15-16.07.29*	CHF	2 400 000	2 400 000		2 292 240	0,10	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.12500% 15-25.02.26*	CHF	2 250 000	2 250 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.60000% 16-11.12.35*	CHF	5 865 000	5 865 000		5 212 226	0,23	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONA-REG-S 0.50000% 16-30.03.34*	CHF	400 000	400 000		358 520	0,02	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONA-REG-S 0.50000% 17-20.02.32*	CHF	550 000	550 000		506 110	0,02	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.25000% 17-26.05.27*	CHF	3 325 000	3 325 000		3 189 008	0,14	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.25000% 17-12.05.26*	CHF	1 100 000	1 100 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWZ KANTNLBKEN-REG-S 0.37500% 17-24.07.28*	CHF	1 900 000	1 900 000		1 808 800	0,08	
PFANDBRIEFZENTR SCHWZ KANTNLBKEN-REG-S 0.25000% 17-06.12.27*	CHF	830 000	830 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 18-24.11.28*	CHF	1 050 000	1 050 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.30000% 19-09.04.29*	CHF	8 250 000	5 250 000	3 000 000	2 822 100	0,12	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 19-15.05.34*	CHF	2 500 000	2 500 000		2 237 000	0,10	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.10000% 19-03.12.31*	CHF	5 000 000	5 000 000		4 462 000	0,19	
PFANDBRIEFZENTR SCHZ KANTLBKEN-REG-S 0.50000% 18-19.05.28*	CHF	3 250 000	3 250 000				
PFANDBRIEFZENTRALE DER SC KANTONA-REG-S 1.85000% 23-22.09.33*	CHF	4 000 000	4 000 000		4 103 600	0,18	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
PfANRIEFBK SCH HYP AG-REG-S 1.37500% 22-10.06.32*	CHF	10 000 000			10 000 000	9 871 000	0,43	
PRIMEO HOLDING AG 0.10000% 21-28.09.29*	CHF	1 560 000			1 560 000	1 422 720	0,06	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 1.00000% 15-06.02.25*	CHF	1 500 000		1 500 000				
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.50000% 16-16.02.24*	CHF	2 000 000		2 000 000				
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.37500% 16-29.04.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	965 500	0,04	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.70000% 19-08.02.27*	CHF	1 450 000			1 450 000	1 399 975	0,06	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 3.12500% 06-15.09.26*	CHF	2 000 000		2 000 000				
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 2.62500% 11-04.02.26*	CHF	250 000		250 000				
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.30000% 16-22.04.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.18250% 20-11.11.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 1.50000% 20-23.11.34*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 262 100	0,05	1 200 000
RIETER HOLDING AG-REG-S 1.55000% 20-17.09.24*	CHF	4 250 000		1 250 000	3 000 000	2 977 500	0,13	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.75000% 22-25.02.31*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 800 000	0,17	250 000
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 1.00000% 22-25.02.37*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 396 500	0,06	
ROCHE KAPITALMARKT AG 1.95000% 23-15.09.38*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 096 780	0,13	
SANDOZ GROUP AG-REG-S 2.12500% 23-17.11.26*	CHF		3 280 000		3 280 000	3 330 840	0,15	
SCHAFFHAUSER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 18-31.05.28*	CHF	1 600 000			1 600 000	1 523 200	0,07	
SGS SA-REG-S 0.75000% 18-29.10.25*	CHF		3 145 000		3 145 000	3 085 245	0,13	
SGS SA-REG-S 0.95000% 20-06.11.26*	CHF	215 000	20 000	235 000				
SGS SA-REG-S 1.25000% 22-05.09.25*	CHF	3 500 000		3 500 000				
SGS SA-REG-S 1.70000% 22-05.09.29*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 487 750	0,15	
SIKA AG-REG-S 0.62500% 18-12.07.24*	CHF	500 000		500 000				
SIX GROUP AG-REG-S 0.20000% 21-28.09.29*	CHF	3 205 000		3 205 000				
SIX GROUP AG-REG-S 0.12500% 21-27.11.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 907 360	0,08	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.75000% 20-06.10.28*	CHF	6 000 000	60 000	3 000 000	3 060 000	2 929 950	0,13	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.05000% 22-19.02.29*	CHF	3 120 000			3 120 000	3 004 560	0,13	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.40000% 22-19.02.32*	CHF	6 370 000			6 370 000	6 178 900	0,27	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.95000% 22-12.12.30*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 249 600	0,14	
ST GALLER KANTONALBANK 1.37500% 12-22.06.27*	CHF	720 000		720 000				
ST GALLER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 15-24.06.25*	CHF	1 450 000			1 450 000	1 423 175	0,06	
ST GALLER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	2 930 000			2 930 000	2 856 750	0,12	10 000
ST GALLER KANTONALBANK AG 0.10000% 19-10.10.41*	CHF	7 665 000			7 665 000	5 863 725	0,26	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S 0.35000% 19-24.01.28*	CHF	500 000		500 000				
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S 0.25000% 21-30.04.35*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 710 000	0,07	
STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-03.10.25*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 367 100	0,06	
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF	7 430 000		7 430 000				
SULZER AG-REG-S 1.60000% 18-22.10.24*	CHF	800 000			800 000	796 080	0,03	
SULZER AG-REG-S 3.35000% 22-16.11.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 581 250	0,11	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 2.00000% 14-10.12.24*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 198 320	0,05	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.82500% 17-11.05.26*	CHF	250 000			250 000	244 000	0,01	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24*	CHF	4 000 000		4 000 000				
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27*	CHF	7 000 000			7 000 000	6 867 000	0,30	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.65000% 20-18.12.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	925 000	0,04	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 21-11.02.28*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 411 500	0,06	
SWISSCOM AG 0.13000% 20-18.09.31*	CHF	3 000 000	3 000 000		6 000 000	5 406 000	0,24	
SWISSCOM AG-REG-S 0.37500% 16-31.03.28*	CHF	3 150 000			3 150 000	3 006 675	0,13	
SWISSCOM AG-REG-S 0.12500% 16-15.09.32*	CHF	3 550 000		3 000 000	550 000	483 175	0,02	350 000
SWISSCOM AG-REG-S 0.37500% 16-15.12.27*	CHF	750 000		750 000				
SWISSCOM AG-REG-S 0.37500% 17-31.05.27*	CHF	2 000 000		2 000 000				
SWISSCOM AG-REG-S 0.75000% 17-24.11.33*	CHF	7 200 000			7 200 000	6 598 800	0,29	
SWISSCOM AG-REG-S 0.50000% 19-15.03.29*	CHF	5 700 000			5 700 000	5 409 300	0,24	
SWISSCOM AG-REG-S 0.75000% 18-12.10.28*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 396 750	0,15	
SWISSCOM AG-REG-S 0.25000% 21-18.05.33*	CHF	4 570 000			4 570 000	4 010 175	0,17	
SWISSCOM AG-REG-S 1.50000% 14-14.07.26*	CHF	2 150 000			2 150 000	2 147 850	0,09	
SWISSCOM AG-REG-S 1.50000% 14-28.09.29*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 800 000	0,08	
SWISSCOM AG-REG-S 1.00000% 15-17.04.35*	CHF	1 900 000			1 900 000	1 768 900	0,08	
SWISSGRID AG-REG-S 0.62500% 15-25.02.30*	CHF	500 000			500 000	470 500	0,02	
SWISSGRID AG-REG-S 0.20000% 20-30.06.32*	CHF	200 000			200 000	176 100	0,01	
SWISSGRID AG-REG-S 0.12500% 20-30.06.36*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 012 500	0,09	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 16-30.05.58*	CHF	7 611 000			7 611 000	7 109 435	0,31	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-24.05.55*	CHF	8 020 000			8 020 000	7 434 540	0,32	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-28.06.45*	CHF	13 800 000			13 800 000	12 879 540	0,56	10 107 000
SWITZERLAND-REG-S 0.25000% 21-23.06.35*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 716 000	0,16	
SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 12-30.04.42*	CHF	16 550 000			16 550 000	18 433 390	0,80	15 350 000
SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 12-27.06.37*	CHF	7 000 000	200 000		6 800 000	7 154 280	0,31	1 226 000
SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 22-26.10.38*	CHF	10 000 000			10 000 000	10 897 000	0,47	7 217 000
SWITZERLAND-REG-S 2.50000% 06-08.03.36*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 558 300	0,15	
SWITZERLAND-REG-S 2.00000% 14-25.06.64*	CHF	12 663 000			12 663 000	18 875 468	0,82	12 663 000
SWITZERLAND-REG-S 4.00000% 99-06.01.49*	CHF	20 710 000			20 710 000	35 592 206	1,55	14 563 000
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.70000% 20-09.12.26*	CHF	500 000			500 000	480 750	0,02	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23*	CHF	1 900 000		1 900 000				

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 919 000	0,21	
TESSIN, CANTON OF 0.40000% 16-27.06.44*	CHF	3 000 000		3 000 000				
TESSIN, CANTON OF-REG-S 2.12500% 10-24.11.34*	CHF	3 040 000		3 040 000				
TESSIN, CANTON OF-REG-S 1.87500% 13-18.03.38*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 446 900	0,06	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.16600% 19-21.12.29*	CHF	815 000		815 000				
TRANSPORTS PUBLICS GENEVOIS-REG-S 0.90000% 15-21.05.35*	CHF	340 000			340 000	307 700	0,01	
TRANSPower NEW ZEALAND LTD 0.02000% 19-16.12.27*	CHF	1 885 000			1 885 000	1 748 338	0,08	
UBS GROUP AG 0.37500% 21-24.08.29*	CHF	5 600 000		2 000 000	3 600 000	3 268 800	0,14	
UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26*	CHF	1 400 000		1 400 000				
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 1.82000% 23-18.10.12.26*	CHF		7 750 000	5 750 000	2 000 000	2 009 000	0,09	
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 2.03500% 23-18.10.33*	CHF		6 250 000		6 250 000	6 450 000	0,28	
UNION BANCAIRE PRIVÉE UBP SA-REG-S 0.20000% 21-15.12.26*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 854 500	0,12	
VALIANT BANK AG 1.85000% 23-31.05.28*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 013 000	0,09	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.12500% 19-04.12.34*	CHF	2 150 000			2 150 000	1 770 525	0,08	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.10000% 21-07.05.31*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 646 000	0,12	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.55500% 21-24.03.31*	CHF	6 500 000			6 500 000	5 934 500	0,26	
VISECA PAYMENT SERVICES AG 2.25000% 23-27.10.26*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 075 000	0,22	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.20000% 17-02.02.26*	CHF	3 000 000		3 000 000				
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.35000% 18-07.09.27*	CHF	1 750 000			1 750 000	1 666 875	0,07	
WESTPAC BANKING CORP 2.01250% 23-13.06.30*	CHF	6 700 000			6 700 000	6 897 650	0,30	
WINTERTHUR, CITY OF 1.87500% 12-20.04.37*	CHF	140 000			140 000	143 290	0,01	
WINTERTHUR, CITY OF-REG-S 1.50000% 13-24.01.36*	CHF	620 000			620 000	608 840	0,03	
WINTERTHUR, CITY OF-REG-S 2.25000% 14-10.02.39*	CHF	200 000			200 000	214 200	0,01	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 2.00000% 10-08.09.25*	CHF	2 100 000			2 100 000	2 111 550	0,09	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 2.00000% 10-30.11.34*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 554 750	0,07	
ZUERCHER KANTONALBANK 2.50000% 11-10.06.31*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 320 000	0,23	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.75000% 15-28.10.30*	CHF	13 400 000			13 400 000	12 663 000	0,55	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 16-23.11.26*	CHF	7 550 000		7 550 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 17-27.01.26*	CHF	1 500 000		300 000	1 200 000	1 165 800	0,05	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 18-08.05.25*	CHF	450 000		450 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 19-06.06.29*	CHF	2 750 000			2 750 000	2 539 625	0,11	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 20-05.02.31*	CHF	12 050 000			12 050 000	10 760 650	0,47	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 20-04.11.32*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 595 000	0,11	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.20000% 22-31.07.30*	CHF	6 000 000			6 000 000	5 481 000	0,24	100 000
ZUERCHER KANTONALBANK 0.20000% 22-31.03.25*	CHF	6 000 000		6 000 000				
ZUERICH, CITY OF-REG-S 1.62500% 23-26.01.37*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 837 800	0,08	
ZUG ESTATES HOLDING AG-REG-S 0.10000% 19-02.10.25*	CHF	2 680 000			2 680 000	2 594 240	0,11	
ZUGER KANTONALBANK 1.65000% 13-02.04.38*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 491 750	0,06	
ZUGER KANTONALBANK AG 0.37500% 16-15.12.27*	CHF	100 000		100 000				
ZUGER KANTONALBANK AG 0.12500% 19-27.06.30*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 357 500	0,06	
ZURICH INSURANCE CO-REG-S 1.50000% 14-22.07.26*	CHF	550 000		550 000				
TOTAL CHF						1 011 685 463	44,05	
Total Anleihen, fester Zins						1 011 685 463	44,05	

Anleihen, Nullcoupon

CHF

AMAG LEASING AG-REG-S 0.00000% 21-18.02.25*	CHF	4 500 000			4 500 000	4 377 600	0,19	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-25.09.26*	CHF	1 000 000		1 000 000				
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 19-23.08.34*	CHF	9 225 000			9 225 000	7 707 488	0,34	200 000
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 19-16.07.29*	CHF	2 025 000			2 025 000	1 824 525	0,08	
FREIBURGER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-26.02.30*	CHF	1 000 000			1 000 000	906 000	0,04	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.00000% 21-05.02.31*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 554 000	0,15	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.00000% 19-23.09.59*	CHF	1 200 000			1 200 000	739 800	0,03	1 200 000
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 19-16.10.29*	CHF	2 700 000			2 700 000	2 465 100	0,11	
KANTONSSPITAL WINTERTHUR-REG-S 0.00000% 21-30.09.25*	CHF	1 500 000		1 500 000				
KOREA RAILROAD CORP-REG-S 0.00000% 19-13.06.25*	CHF	2 490 000			2 490 000	2 419 035	0,11	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-07.08.28*	CHF	2 500 000		2 500 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-26.08.49*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 029 500	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 599 190	0,07	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 20-10.05.45*	CHF	2 850 000			2 850 000	2 034 900	0,09	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-27.01.27*	CHF	2 800 000		2 800 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-02.10.26*	CHF	1 600 000			1 600 000			
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 19-23.06.25*	CHF	1 000 000			1 000 000			
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 20-02.04.31*	CHF	1 850 000			1 850 000	1 656 305	0,07	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBK-REG-S 0.00000% 20-15.03.30*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 367 250	0,06	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.00000% 19-06.02.30*	CHF	1 250 000			1 250 000	1 102 333	0,05	
SWISSCOM AG-REG-S 0.00000% 19-30.08.44*	CHF	3 450 000			3 450 000	2 432 595	0,11	
SWISSGRID AG-REG-S 0.00000% 20-30.06.28*	CHF	800 000			800 000	744 000	0,03	
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-26.06.34*	CHF		45 000 000		45 000 000	41 044 500	1,79	
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-24.07.39*	CHF	13 689 000	50 000 000		63 689 000	55 931 680	2,44	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 23-26.06.34*	CHF		45 000 000	45 000 000				
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 23-24.07.39*	CHF		50 000 000	50 000 000				
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.07.29*	CHF	1 900 000			1 900 000	1 720 450	0,07	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.10.25*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 641 350	0,07	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-14.02.29*	CHF	4 500 000		4 500 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-12.03.30*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 537 650	0,07	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.00000% 21-21.01.33*	CHF	10 000 000			10 000 000	8 590 000	0,37	
TOTAL CHF						147 425 250	6,42	
Total Anleihen, Nullcoupon						147 425 250	6,42	

Anleihen, variabler Zins

CHF

BALOISE LIFE LTD-SUB 2.200%/VAR 17-19.06.48*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 370 500	0,15	1 275 000
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERU-REG-S-SUB 1.450%/VAR 20-12.08.40*	CHF	1 000 000			1 000 000	894 500	0,04	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-25.09.48*	CHF	4 685 000			4 685 000	4 544 450	0,20	
TOTAL CHF						8 809 450	0,38	
Total Anleihen, variabler Zins						8 809 450	0,38	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						2 280 470 542	99,29	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Global

UBS (CH) MONEY MARKET FUND - CHF I-X**	CHF	31 000	35 000	65 995	5	4 446	0,00	
TOTAL Global						4 446	0,00	
Total Investmentzertifikate, open end						4 446	0,00	

Anleihen, fester Zins

CHF

UBS AG/LONDON 0.71000% 22-13.04.25**	CHF	2 000 000			2 000 000	1 963 879	0,09	
TOTAL CHF						1 963 879	0,09	
Total Anleihen, fester Zins						1 963 879	0,09	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						1 968 325	0,09	

Nicht-Effekten

Treasury-Bills, Nullcoupon

CHF

SWISS NATIONAL BANK BILL TB 0.00000% 21.08.23-18.09.23**	CHF		25 000 000	25 000 000				
TOTAL CHF							0,00	
Total Treasury-Bills, Nullcoupon							0,00	
Total Nicht-Effekten							0,00	
Total Wertschriften						2 282 438 867	99,38	
(davon ausgeliehen)						112 868 054	4,91	
Bankguthaben auf Sicht						1 255 031	0,05	
Derivative Finanzinstrumente						-1 181 789	-0,05	
Sonstige Vermögenswerte						14 292 102	0,62	
Gesamtfondsvermögen						2 296 804 211	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-5 022 262		
Andere Verbindlichkeiten						-47 611		
Nettofondsvermögen						2 291 734 338		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.11.2023	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	2 280 470 542	99,29
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	786 536	0,04
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
TOTAL	2 281 257 078	99,33

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/ Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 2.10000% 23-10.03.25**	55 000 000	CHF	55 000 000	-640 574	-0.03
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-10.03.25	55 000 000	CHF			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 2.05750% 23-09.03.25**	50 000 000	CHF	50 000 000	-541 215	-0.02
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-09.03.25	50 000 000	CHF			
			105 000 000	-1 181 789	-0.05

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.49250% 23-15.03.25	CHF	48 000 000	48 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-15.03.25	CHF	48 000 000	48 000 000
GS/INTEREST RATE SWAP REC 2.00000% 23-18.04.38	CHF	40 000 000	40 000 000
GS/INTEREST RATE SWAP PAY SARON O/N 23-18.04.38	CHF	40 000 000	40 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
UBS/INTEREST RATE SWAP REC 2.03000% 23-03.03.38	CHF	18 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY SARON O/N 23-03.03.38	CHF	18 000 000

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission:	
Klasse I-X:	0,00% p.a.;
Klasse P:	0,90% p.a.;
Klasse Q:	0,50% p.a.;
Klasse U-X:	0,00% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:	
Klasse I-X:	0,00% p.a.;
Klasse P:	1,08% p.a.;
Klasse Q:	1,05% p.a.;
Klasse U-X:	0,00% p.a.;

berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der AMAS in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-X:	0,00%
Klasse P:	0,90%
Klasse Q:	0,50%
Klasse U-X:	0,00%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 2% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Bewertungs-Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert.

Umrechnungskurs

EUR 1 = CHF 0.95

UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)

Art Effektenfonds

Wichtigste Daten

	ISIN	30.11.2023	31.5.2023	31.5.2022
Nettofondsvermögen in CHF		54 243 200.49	60 766 063.91	70 946 389.28
Klasse P	CH0002788526			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		59.80	62.24	67.40
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		59.80	62.24	67.35
Anzahl Anteile im Umlauf		869 532,5000	935 014,1590	1 011 127,4810
Klasse Q	CH0203279556			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		77.60	81.01	87.77
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		77.60	81.01	87.70
Anzahl Anteile im Umlauf		28 878,4710	31 678,4710	31 813,1230

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

Vereinigte Staaten von Amerika	23,35
Japan	17,87
Grossbritannien	9,17
Kanada	6,92
Frankreich	5,42
Italien	4,61
Spanien	4,51
Neuseeland	2,93
Supranational	2,35
Deutschland	2,04
Übrige	15,87
TOTAL	95,04

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.11.2023	31.5.2023
Verkehrswerte	CHF	CHF
Bankguthaben		
– auf Sicht	1 155 703.93	4 662 356.83
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	51 706 590.45	58 071 550.07
Derivative Finanzinstrumente	1 045 711.46	-424 550.99
Sonstige Vermögenswerte	502 492.24	472 181.73
Gesamtfondsvermögen	54 410 498.08	62 781 537.64
Aufgenommene Kredite	-113 871.71	-1 959 394.55
Andere Verbindlichkeiten	-53 425.88	-56 079.18
Nettofondsvermögen	54 243 200.49	60 766 063.91

Erfolgsrechnung

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
Ertrag	CHF	CHF
Erträge der Bankguthaben	21 252.25	11 232.01
Negativzinsen	-1 854.81	-9 180.56
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	575 074.49	1 108 321.94
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	128 927.04	296 792.88
Erträge der Effektenleihe	6 742.47	18 003.47
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	1 099.70	8 876.53
TOTAL Ertrag	731 241.14	1 434 046.27
Aufwand		
Passivzinsen	-678.42	-953.24
Prüfaufwand	0.00	-14 684.90
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P	-312 451.68	-699 687.75
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q	-7 494.65	-15 793.64
Sonstige Aufwendungen	-1 182.75	-4 061.52
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-17 804.34	-29 235.33
TOTAL Aufwand	-339 611.84	-764 416.38
Nettoertrag	391 629.30	669 629.89
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	-1 247 293.22	1 942 226.12
Realisierter Erfolg	-855 663.92	2 611 856.01
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-858 926.29	-7 221 949.24
Gesamterfolg	-1 714 590.21	-4 610 093.23

¹ Realisierte Kapitalgewinne und -verluste können Aufwendungen und Erträge aus Swinging Single Pricing enthalten.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	60 766 063.91	70 946 389.28
Ordentliche Jahresausschüttung	-645 474.55	-716 871.42
Saldo aus dem Anteilverkehr	-4 162 798.66	-4 853 360.72
Gesamterfolg	-1 714 590.21	-4 610 093.23
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	54 243 200.49	60 766 063.91

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
Klasse P	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	935 014,1590	1 011 127,4810
Ausgegebene Anteile	5 539,0910	21 608,5000
Zurückgenommene Anteile	-71 020,7500	-97 721,8220
Bestand Ende Berichtsperiode	869 532,5000	935 014,1590
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-65 481,6590	-76 113,3220
Klasse Q	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	31 678,4710	31 813,1230
Ausgegebene Anteile	107,0000	100,3500
Zurückgenommene Anteile	-2 907,0000	-235,0020
Bestand Ende Berichtsperiode	28 878,4710	31 678,4710
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-2 800,0000	-134,6520

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
Notes, fester Zins							
BRL							
BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 10.00000% 22-01.01.33*	BRL	3 500	500	3 000	502 080	0,92	
TOTAL BRL					502 080	0,92	
EUR							
BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 4.00000% 12-28.03.32*	EUR	794 000		794 000	810 883	1,49	
CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26*	EUR	250 000		250 000	218 529	0,40	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28*	EUR	100 000		100 000	83 664	0,15	100 000
ROCHE FINANCE EUROPE BV-REG-S 3.31200% 23-04.12.27*	EUR		120 000	120 000	114 512	0,21	
ROMANIA-REG-S 2.62500% 20-02.12.40*	EUR	370 000		370 000	213 259	0,39	370 000
TAPESTRY INC 5.37500% 23-27.11.27*	EUR		120 000	120 000	115 074	0,21	
TOTAL EUR					1 555 921	2,86	
GBP							
UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 3.75000% 23-22.10.53*	GBP	500 000	175 000	675 000	632 970	1,16	
TOTAL GBP					632 970	1,16	
USD							
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26*	USD	225 000		225 000	178 234	0,33	
AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.25*	USD	90 000		90 000	77 964	0,14	
AMGEN INC 5.50700% 23-02.03.26*	USD	115 000		115 000	99 950	0,18	
AT&T INC 5.53900% 23-20.02.26*	USD	115 000		115 000	100 023	0,18	
BANK OF NOVA SCOTIA 5.25000% 22-06.12.24*	USD	85 000		85 000	73 655	0,14	
CHILE, REPUBLIC OF 3.86000% 17-21.06.47*	USD	200 000		200 000			
DIAGEO CAPITAL PLC 2.12500% 19-24.10.24*	USD	320 000		320 000	269 809	0,50	
ENBRIDGE INC 5.90000% 23-15.11.26*	USD		60 000	60 000	53 067	0,10	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.00000% 23-11.01.28*	USD	200 000		200 000	174 693	0,32	200 000
GEORGIA POWER CO 2.10000% 20-30.07.23*	USD	85 000		85 000			
PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.45000% 23-19.05.28*	USD	120 000		120 000	102 701	0,19	
ROMANIA-REG-S 5.12500% 18-15.06.48*	USD	300 000		300 000	207 544	0,38	300 000
TAPESTRY INC 7.00000% 23-27.11.26*	USD		100 000	100 000	87 893	0,16	
TELEFONICA EMISIONES SA 5.52000% 19-01.03.49*	USD	200 000		200 000	154 644	0,28	200 000
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.21500% 21-18.10.24*	USD	100 000		100 000	83 681	0,15	
TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-19.01.33*	USD	200 000		200 000			
VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24*	USD	80 000		80 000	67 289	0,12	
TOTAL USD					1 731 147	3,18	
Total Notes, fester Zins					4 422 118	8,13	
Notes, variabler Zins							
EUR							
UBS GROUP AG-REG-S 2.875%/VAR 22-02.04.32*	EUR	100 000		100 000	85 410	0,16	
TOTAL EUR					85 410	0,16	
Total Notes, variabler Zins					85 410	0,16	
Medium-Term Notes, fester Zins							
AUD							
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 4.50000% 15-05.06.25*	AUD	200 000		200 000	112 690	0,21	
NEW ZEALAND LOC GOV FUNDING AGENCY 4.70000% 23-01.08.28*	AUD		140 000	140 000	80 279	0,15	
TOTAL AUD					192 969	0,35	
EUR							
ASB BANK LTD-REG-S 0.25000% 21-08.09.28*	EUR	100 000		100 000	79 891	0,15	
BPCE SA-REG-S 2.37500% 22-26.04.32*	EUR		100 000	100 000	84 694	0,16	
BPCE SA-REG-S 4.00000% 22-29.11.32*	EUR	100 000		100 000			
BPCE SA-REG-S 4.50000% 23-13.01.33*	EUR	100 000		100 000	95 924	0,18	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMME-REG-S 0.37500% 22-10.03.26*	EUR	155 000		155 000	136 991	0,25	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 3.39000% 22-05.12.25*	EUR	270 000		270 000	253 953	0,47	
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23*	EUR	145 000		145 000			

Titel			31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
			Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.049000% 22-22.11.29*	EUR		35 000		35 000				
ENGIE SA-REG-S 0.375000% 21-26.10.29*	EUR		200 000			200 000	156 884	0,29	
EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.500000% 17-11.07.25*	EUR		400 000			400 000	363 597	0,67	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.375000% 18-16.07.25*	EUR		200 000			200 000	181 489	0,33	
GAS NETWORKS IRELAND-REG-S 0.125000% 19-04.12.24*	EUR		100 000			100 000	91 203	0,17	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.250000% 21-26.01.28*	EUR		70 000		70 000				
HOWOGE WOHNUNGS-BAUGESSELLSCHAFT-REG-S 0.625000% 21-01.11.28*	EUR		100 000			100 000	80 884	0,15	
KBC GROUP NV-REG-S 1.125000% 19-25.01.24*	EUR		100 000			100 000	94 449	0,17	
NATIONAL GAS TRANSMISSION PLC-REG-S 4.250000% 23-05.04.30*	EUR		100 000			100 000	95 676	0,18	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 4.500000% 23-01.11.26*	EUR			100 000		100 000	96 272	0,18	
NESTE OYJ-REG-S 3.875000% 23-21.05.31*	EUR			100 000		100 000	95 321	0,18	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.250000% 20-23.01.27*	EUR		190 000			190 000	163 807	0,30	
P3 GROUP SARL-REG-S 0.875000% 22-26.01.26*	EUR		155 000			155 000	134 203	0,25	
POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.000000% 19-08.03.49*	EUR		375 000			375 000	230 774	0,42	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-REG-S 4.125000% 22-08.09.25*	EUR		100 000			100 000	94 573	0,17	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.625000% 22-23.03.26*	EUR		170 000			170 000	151 219	0,28	
RTE RSU DE TRNSPRT D'ELCTRCTE SDR-REG-S 3.750000% 23-04.07.35*	EUR			100 000	100 000				
RWE AG-REG-S 2.750000% 22-24.05.30*	EUR		175 000			175 000	156 130	0,29	
SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.375000% 23-06.04.25*	EUR		100 000			100 000	94 494	0,17	
SNAM SPA-REG-S 4.000000% 23-27.11.29*	EUR			100 000		100 000	95 189	0,17	
TENNET HOLDING BV-REG-S 0.875000% 21-16.06.35*	EUR		150 000			150 000	120 787	0,22	
TOTAL EUR							3 148 404	5,79	

USD

INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.875000% 20-03.04.25*	USD		330 000			330 000	271 500	0,50
SVENSK EXPORTKREDIT AB 4.375000% 23-13.02.26*	USD		200 000			200 000	172 011	0,32
TOTAL USD							443 511	0,82
Total Medium-Term Notes, fester Zins							3 784 885	6,96

Medium-Term Notes, Nullcoupon

EUR

CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SO-REG-S 0.000000% 20-25.02.28*	EUR		500 000			500 000	417 982	0,77
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.000000% 20-15.09.28*	EUR		565 000			565 000	467 535	0,86
LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK-REG-S 0.000000% 21-30.06.31*	EUR		180 000			180 000	136 667	0,25
NOVO NORDISK FINCE NETHERLANDS BV-REG-S 0.000000% 21-04.06.24*	EUR		105 000			105 000	97 650	0,18
STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.000000% 21-16.11.26*	EUR		100 000			100 000	85 222	0,16
TOTAL EUR							1 205 055	2,21
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon							1 205 055	2,21

Medium-Term Notes, variabler Zins

EUR

TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP*	EUR		100 000			100 000	91 935	0,17
TOTAL EUR							91 935	0,17

USD

BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26*	USD		150 000			150 000	125 995	0,23
TOTAL USD							125 995	0,23
Total Medium-Term Notes, variabler Zins							217 931	0,40

Anleihen, fester Zins

AUD

AUSTRALIA-REG-S 3.750000% 14-21.04.37*	AUD		900 000			900 000	478 119	0,88
TOTAL AUD							478 119	0,88

CAD

CANADA, GOVERNMENT 1.500000% 15-01.06.26*	CAD		2 910 000			2 910 000	1 759 458	3,23
CANADA, GOVERNMENT 1.500000% 19-01.09.24*	CAD		1 630 000			1 630 000	1 021 086	1,88
CANADA, GOVERNMENT 2.250000% 18-01.06.29*	CAD		300 000			300 000	180 092	0,33
CANADA, GOVERNMENT 4.000000% 08-01.06.41*	CAD		200 000			200 000	136 943	0,25
TOTAL CAD							3 097 578	5,69

CNY

CHINA DEVELOPMENT BANK 3.300000% 21-03.03.26*	CNY		2 000 000			2 000 000	247 754	0,46
TOTAL CNY							247 754	0,46

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹ Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal				
DKK								
DENMARK, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.50000% 19-15.11.29*	DKK	2 400 000			2 400 000	271 424	0,50	
TOTAL DKK						271 424	0,50	
EUR								
ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23*	EUR	125 000		125 000				
BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 4.25000% 10-28.03.41*	EUR	100 000			100 000	104 464	0,19	
EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40*	EUR	235 000			235 000	129 974	0,24	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.50000% 10-25.04.26*	EUR	415 000			415 000	399 302	0,73	415 000
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.75000% 12-25.10.27*	EUR	200 000			200 000	189 784	0,35	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.25000% 15-25.05.36*	EUR	100 000			100 000	75 983	0,14	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 17-25.06.39*	EUR	593 000			593 000	458 212	0,84	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50*	EUR	650 000			650 000	406 343	0,75	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 19-25.05.29*	EUR	400 000		250 000	150 000	126 290	0,23	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 20-25.05.40*	EUR	600 000			600 000	364 761	0,67	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 17-15.08.27*	EUR	200 000		200 000				
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 18-15.08.28*	EUR	120 000		120 000				
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 22-15.05.38*	EUR	110 000	80 000		190 000	144 528	0,27	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 98-04.07.28*	EUR	130 000		130 000				
IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 15-18.02.45*	EUR	610 000			610 000	458 525	0,84	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 3.75000% 14-01.09.24*	EUR	400 000			400 000	379 681	0,70	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46*	EUR	1 035 000		235 000	800 000	614 196	1,13	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.65000% 15-01.03.32*	EUR	1 268 000		1 268 000				
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 3.00000% 19-01.08.29*	EUR	615 000			615 000	565 385	1,04	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.45000% 20-01.09.50*	EUR	250 000			250 000	160 014	0,29	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 2.65000% 22-01.12.27*	EUR	750 000			750 000	691 650	1,27	
JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 3.12500% 23-15.02.28*	EUR	120 000			120 000	113 650	0,21	120 000
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25*	EUR	175 000			175 000	146 931	0,27	175 000
NETHERLANDS, KINGDOM-144A-REG-S 5.50000% 98-15.01.28*	EUR	541 000			541 000	569 732	1,05	
SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 23-23.02.35*	EUR	200 000			200 000	186 230	0,34	
SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45*	EUR	645 000			645 000	563 311	1,04	
SPAIN, KINGDOM OF-144A 5.15000% 13-31.10.28*	EUR	600 000			600 000	623 305	1,15	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 5.15000% 13-31.10.44*	EUR	200 000			200 000	220 636	0,41	200 000
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 15-30.07.30*	EUR		200 000		200 000	176 110	0,32	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.15000% 15-31.10.25*	EUR	946 000			946 000	882 099	1,62	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.45000% 16-30.07.66*	EUR	150 000			150 000	121 417	0,22	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 4.20000% 05-31.01.37*	EUR	108 000			108 000	107 675	0,20	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35*	EUR	212 000			212 000	167 687	0,31	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 22-31.10.52*	EUR		435 000	435 000				
TOTAL EUR						9 147 875	16,82	
GBP								
DERWENT LONDON PLC-REG-S 1.87500% 21-17.11.31*	GBP	185 000			185 000	151 681	0,28	
ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26*	GBP		100 000		100 000	101 488	0,19	
UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 1.25000% 20-22.10.41*	GBP	600 000			600 000	393 606	0,72	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 06-07.12.27*	GBP	141 000			141 000	155 989	0,29	141 000
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.47*	GBP	1 350 000			1 350 000	816 918	1,50	1 350 000
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN&N-REG-S 3.50000% 14-22.01.45*	GBP	430 000			430 000	398 889	0,73	
UNITED KINGDOM TREASURY GILT-REG-S 1.12500% 21-31.01.39*	GBP	100 000			100 000	69 307	0,13	
UNITED KINGDOM TREASUR GILT STRIP-REG-S 0.37500% 21-22.10.26*	GBP	1 500 000			1 500 000	1 479 732	2,72	
TOTAL GBP						3 567 611	6,56	
JPY								
DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 2.30000% 06-19.03.26*	JPY	280 000 000			280 000 000	1 723 135	3,17	
JAPAN 0.10000% 18-20.03.28*	JPY	30 000 000		30 000 000				
JAPAN 0.10000% 19-20.12.28*	JPY	58 000 000		58 000 000				
JAPAN 0.10000% 21-20.03.31*	JPY	45 000 000			45 000 000	257 639	0,47	
JAPAN 0.30000% 16-20.06.46*	JPY	20 000 000			20 000 000	90 204	0,17	
JAPAN 0.50000% 19-20.12.38*	JPY		70 000 000		70 000 000	376 040	0,69	
JAPAN 0.80000% 18-20.03.58*	JPY	85 000 000	55 000 000		140 000 000	629 457	1,16	
JAPAN 0.90000% 22-20.06.42*	JPY		56 500 000		56 500 000	306 897	0,56	
JAPAN 1.10000% 03-20.03.33*	JPY	650 000 000			650 000 000	3 977 308	7,31	
JAPAN 1.20000% 14-20.12.34*	JPY	218 550 000			218 550 000	1 339 916	2,46	
JAPAN 1.70000% 13-20.12.43*	JPY	148 000 000			148 000 000	908 493	1,67	
TOTAL JPY						9 609 088	17,66	
MXN								
MEXICO, UNITED MEXICAN STATES 7.75000% 11-13.11.42*	MXN	190 000		10 000	180 000	764 561	1,41	
TOTAL MXN						764 561	1,41	

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
NZD							
NEW ZEALAN, REPUBLIC OF 0.25000% 20-15.05.28*	NZD	500 000		500 000	220 323	0,40	
NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41*	NZD		1 000 000	1 000 000	328 906	0,60	
NEW ZEALAND-REG-S 2.75000% 16-15.04.37*	NZD	1 100 000		1 100 000	458 828	0,84	
NEW ZEALAND-REG-S 4.50000% 14-15.04.27*	NZD	800 000		800 000	425 701	0,78	
TOTAL NZD					1 433 757	2,64	

SEK

SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 3.50000% 09-30.03.39*	SEK	750 000		750 000	67 681	0,12	750 000
TOTAL SEK					67 681	0,12	

USD

ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 19-30.09.29*	USD	400 000		400 000	309 560	0,57	
COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41*	USD	410 000		410 000	296 086	0,54	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.12500% 20-22.10.25*	USD	200 000	200 000				
PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33*	USD	140 000		140 000	147 910	0,27	140 000
TOTAL USD					753 556	1,38	

ZAR

SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 8.75000% 12-28.02.48*	ZAR	12 565 000		12 565 000	424 081	0,78	
TOTAL ZAR					424 081	0,78	
Total Anleihen, fester Zins					29 863 088	54,89	

Anleihen, Nullcoupon

EUR

BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND-REG-S 0.00000% 22-15.02.2032*	EUR	90 000		90 000	70 456	0,13	90 000
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.31*	EUR	70 000		70 000	55 530	0,10	
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE 0.00000% 21-18.11.25*	EUR	100 000		100 000	88 501	0,16	
TOTAL EUR					214 487	0,39	
Total Anleihen, Nullcoupon					214 487	0,39	

Anleihen, variabler Zins

GBP

M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51*	GBP	110 000		110 000	109 734	0,20	
SANTANDER UK GROUP HOLD PLC-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP*	GBP	200 000		200 000	217 409	0,40	
TOTAL GBP					327 143	0,60	
Total Anleihen, variabler Zins					327 143	0,60	

Treasury-Notes, fester Zins

USD

AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39*	USD	3 040 500		3 040 500	2 338 583	4,30	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 12-15.08.42*	USD	1 709 000		1 709 000	1 121 918	2,06	1 072 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 15-15.02.45*	USD	685 000		685 000	417 764	0,77	685 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45*	USD		300 000	300 000			
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 16-15.05.46*	USD	46 000		46 000	27 657	0,05	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 16-15.08.46*	USD	1 505 000		905 000	515 970	0,95	905 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.08.47*	USD	365 000		365 000	228 505	0,42	365 000
AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-15.02.48*	USD		150 000	150 000	98 344	0,18	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 19-15.05.49*	USD	900 000		900 000	575 146	1,06	900 000
AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 20-15.05.50*	USD	250 000		250 000	106 749	0,20	250 000
AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 20-15.08.40*	USD	300 000		300 000	153 299	0,28	300 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 21-15.05.51*	USD	170 000		170 000	97 113	0,18	170 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-15.05.52*	USD	100 000		100 000	63 861	0,12	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.05.28*	USD	400 000		400 000	327 141	0,60	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29*	USD	1 250 000	440 000	810 000	647 769	1,19	810 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27*	USD	1 000 000		1 000 000	813 369	1,49	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-30.11.26*	USD	800 000	500 000	300 000	240 322	0,44	300 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30*	USD	1 500 000		1 500 000	1 023 080	1,88	1 500 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-30.09.27*	USD	400 000	400 000				
AMERICA, UNITED STATES OF TIGER STRIP 0.50000% 21-28.02.26*	USD	600 000		600 000			
AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31*	USD	360 000		360 000	259 455	0,48	360 000
AMERICA, UNITED STATES OF TREASURY NOTE 0.37500% 21-15.07.24*	USD	700 000	700 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-15.08.31*	USD	180 000		180 000	125 075	0,23	180 000

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 21-30.11.23*	USD	300 000		300 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 3.25000% 22-30.06.27*	USD		800 000		800 000	669 309	1,23	800 000
AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 22-30.11.27*	USD		600 000		600 000	512 233	0,94	
TOTAL USD						10 362 661	19,05	
Total Treasury-Notes, fester Zins						10 362 661	19,05	

Treasury-Notes, variabler Zins

USD

AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 15-15.02.45*	USD	180 000		180 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.000%/CPI LINKED 18-15.02.48*	USD	100 000		100 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 22-15.04.27*	USD	800 000		800 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.250%/CPI LINKED 23-15.04.28*	USD		750 000		750 000	640 540	1,18	
TOTAL USD						640 540	1,18	
Total Treasury-Notes, variabler Zins						640 540	1,18	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						51 123 317	93,96	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

USD

BANK OF MONTREAL 5.20000% 23-12.12.24*	USD	205 000		205 000	177 407	0,33	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.14400% 23-28.04.25*	USD	90 000		90 000	77 740	0,14	
CARRIER GLOBAL CORP-144A 5.80000% 23-30.11.25*	USD		200 000	200 000	174 917	0,32	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 6.25000% 23-03.11.25*	USD		175 000	175 000	153 210	0,29	
TOTAL USD					583 273	1,08	
Total Notes, fester Zins					583 273	1,08	

Anleihen, variabler Zins

NZD

NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40*	NZD	610 000		610 000			
TOTAL NZD						0,00	
Total Anleihen, variabler Zins						0,00	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						583 273	1,08
Total Wertschriften						51 706 590	95,04

(davon ausgeliehen)					11 804 130	21,69)	
Bankguthaben auf Sicht					1 155 704	2,12	
Derivative Finanzinstrumente					1 045 711	1,92	
Sonstige Vermögenswerte					502 493	0,92	
Gesamtfondsvermögen					54 410 498	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-113 872		
Andere Verbindlichkeiten					-53 426		
Nettofondsvermögen					54 243 200		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.11.2023	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	51 701 455	95,03
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	1 050 846	1,93
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
TOTAL	52 752 301	96,96

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/ Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.23*	-16	EUR	-1 599 771	-455	0.00
EURO-BUXL FUTURE 07.12.23*	-9	EUR	-1 110 910	-10 076	-0.02
EURO-OAT FUTURE 07.12.23*	-3	EUR	-361 793	-10 911	-0.02
EURO-BOBL FUTURE 07.12.23*	-4	EUR	-445 920	-1 746	0.00
LONG GILT FUTURE 26.03.24*	-10	GBP	-1 064 260	-13 870	-0.03
JAPANESE GOVERNMENT 10Y BOND MINI (SGX) FUTURE 12.12.23*	-6	JPY	-517 583	-2 223	0.00
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.23*	-10	JPY	-8 614 624	-33 292	-0.06
US LONG BOND FUTURE 19.03.24*	-12	USD	-1 214 979	-9 782	-0.02
CAN 10YR BOND FUTURE 19.03.24*	-27	CAD	-2 073 760	-14 892	-0.03
			-17 003 600	-97 247	-0.18

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 07.12.23*	3	EUR	376 537	9 137	0.02
CAN 5YR BOND FUTURE 19.03.24*	11	CAD	779 751	5 362	0.01
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24*	4	USD	427 819	6 114	0.01
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24*	22	USD	2 171 565	15 394	0.03
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24*	29	USD	2 768 742	16 943	0.03
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24*	13	USD	2 311 257	7 859	0.01
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24*	64	USD	5 946 417	31 303	0.06
			14 782 088	92 112	0.17

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
BRL	2 870 000	USD	577 546	06.12.2023	-3 510	-0.01
CNY	1 940 000	USD	270 817	06.12.2023	-1 628	0.00
MXN	15 690 000	CHF	784 983	06.12.2023	333	0.00
JPY	1 625 800 000	CHF	9 784 021	06.12.2023	219 574	0.40
USD	86 968	JPY	13 100 000	06.12.2023	1 471	0.00
EUR	16 495 000	CHF	15 810 952	06.12.2023	164 622	0.30
USD	18 625 000	CHF	16 776 016	06.12.2023	586 526	1.08
CAD	4 695 000	CHF	3 063 557	06.12.2023	53 473	0.10
DKK	2 190 000	CHF	281 448	06.12.2023	2 813	0.01
AUD	1 005 000	CHF	583 913	06.12.2023	4 623	0.01
CHF	545 813	NOK	6 750 000	06.12.2023	-1 411	0.00
GBP	4 060 000	CHF	4 459 569	06.12.2023	-8 168	-0.02
ZAR	8 930 000	CHF	436 432	06.12.2023	26 933	0.05
SEK	800 000	CHF	64 885	06.12.2023	-1 485	0.00
NZD	2 755 000	CHF	1 465 778	06.12.2023	-13 343	-0.02
USD	190 000	CHF	170 928	06.12.2023	5 774	0.01
USD	205 000	CHF	183 967	06.12.2023	5 774	0.01
EUR	105 000	CHF	101 003	06.12.2023	1 406	0.00
SEK	1 321 007	NOK	1 340 000	06.12.2023	-1 520	0.00
CAD	90 000	CHF	59 000	06.12.2023	1 299	0.00
USD	215 000	CHF	192 505	06.12.2023	5 619	0.01
GBP	80 000	CHF	88 765	06.12.2023	731	0.00
EUR	75 000	CHF	72 227	06.12.2023	1 086	0.00

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
CHF	23 994	EUR	25 000	06.12.2023	-280	0.00
CHF	139 083	USD	155 000	06.12.2023	-4 352	-0.01
USD	145 000	CHF	130 147	06.12.2023	4 108	0.01
USD	105 000	CHF	94 355	06.12.2023	3 086	0.01
NZD	110 000	CHF	58 601	06.12.2023	-457	0.00
EUR	60 000	CHF	57 692	06.12.2023	779	0.00
CHF	234 023	USD	260 000	06.12.2023	-8 022	-0.01
JPY	8 200 000	CHF	48 898	06.12.2023	658	0.00
USD	21 361	EUR	20 000	06.12.2023	404	0.00
NZD	200 000	CAD	164 844	06.12.2023	-1 692	0.00
EUR	110 000	GBP	95 925	06.12.2023	1 218	0.00
USD	370 000	CHF	327 756	06.12.2023	6 139	0.01
GBP	70 000	CHF	77 172	06.12.2023	142	0.00
EUR	65 000	CHF	62 563	06.12.2023	907	0.00
ZAR	450 000	USD	24 550	06.12.2023	705	0.00
CHF	115 260	USD	130 000	06.12.2023	-2 259	0.00
CAD	164 349	EUR	110 000	06.12.2023	-1 028	0.00
SEK	1 289 301	NOK	1 330 000	06.12.2023	304	0.00
EUR	55 000	CHF	53 011	06.12.2023	841	0.00
USD	135 000	CHF	119 608	06.12.2023	2 261	0.00
USD	60 000	CHF	52 910	06.12.2023	756	0.00
USD	60 000	BRL	294 198	06.12.2023	-333	0.00
EUR	55 000	USD	60 110	06.12.2023	79	0.00
CHF	141 388	USD	160 000	06.12.2023	-2 311	0.00
JPY	7 000 000	CHF	41 599	06.12.2023	419	0.00
GBP	135 000	CHF	149 202	06.12.2023	645	0.00
EUR	30 000	CHF	28 879	06.12.2023	422	0.00
CHF	19 275	EUR	20 000	06.12.2023	-304	0.00
EUR	100 000	USD	109 118	06.12.2023	-6	0.00
CHF	44 377	GBP	40 000	06.12.2023	-360	0.00
CHF	109 950	USD	125 000	06.12.2023	-1 295	0.00
JPY	5 500 000	CHF	32 616	06.12.2023	260	0.00
CHF	144 883	USD	165 000	06.12.2023	-1 459	0.00
USD	273 625	CNY	1 940 000	06.12.2023	-808	0.00
CNY	1 940 000	USD	273 915	05.01.2024	279	0.00
CHF	280 420	USD	320 000	06.12.2023	-2 265	0.00
EUR	60 000	CHF	57 717	06.12.2023	804	0.00
BRL	2 580 000	USD	524 977	05.01.2024	3 455	0.01
USD	525 674	BRL	2 575 802	06.12.2023	-3 226	-0.02
USD	165 000	CHF	144 395	06.12.2023	971	0.00
GBP	20 000	CHF	22 147	06.12.2023	138	0.00
EUR	65 000	CHF	62 140	06.12.2023	484	0.00
AUD	30 000	CHF	17 340	06.12.2023	47	0.00
					1 050 846	1.93

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.06.23	EUR	9	0
EURO-BOBL FUTURE 08.06.23	EUR	7	0
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.23	EUR	16	0
EURO-BUXL FUTURE 08.06.23	EUR	7	0
EURO-OAT FUTURE 08.06.23	EUR	3	0
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.09.23	EUR	9	9
EURO-BOBL FUTURE 07.09.23	EUR	19	19

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
EURO-SCHATZ FUTURE 07.09.23	EUR	16	16
EURO-BUXL FUTURE 07.09.23	EUR	7	7
EURO-OAT FUTURE 07.09.23	EUR	3	3
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.23	EUR	0	16
EURO-BUXL FUTURE 07.12.23	EUR	0	9
EURO-OAT FUTURE 07.12.23	EUR	3	6
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.12.23	EUR	8	8
EURO-BOBL FUTURE 07.12.23	EUR	3	7
LONG GILT FUTURE 26.03.24	GBP	0	10
LONG GILT FUTURE 27.09.23	GBP	6	0
LONG GILT FUTURE 27.12.23	GBP	10	10
JAPANESE GOVERNMENT 10Y BOND MINI (SGX) FUTURE 12.06.23	JPY	6	0
JAPANESE GOVERNMENT 10Y BOND MINI (SGX) FUTURE 11.09.23	JPY	6	6
JAPANESE GOVERNMENT 10Y BOND MINI (SGX) FUTURE 12.12.23	JPY	0	6
AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.06.23	AUD	28	0
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.23	JPY	10	0
CAN 10YR BOND FUTURE 20.09.23	CAD	18	0
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 12.09.23	JPY	10	10
US LONG BOND FUTURE 20.09.23	USD	11	0
US LONG BOND FUTURE 19.12.23	USD	14	14
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.23	JPY	5	15
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23	CAD	18	18
US LONG BOND FUTURE 19.03.24	USD	0	12
CAN 10YR BOND FUTURE 19.03.24	CAD	0	27

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BOBL FUTURE 07.09.23	EUR	6	6
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.12.23	EUR	1	1
EURO-BUND FUTURE 07.12.23	EUR	3	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.23	USD	13	56
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.09.23	USD	0	18
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.23	USD	7	47
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.23	USD	9	38
CAN 5YR BOND FUTURE 20.09.23	CAD	9	28
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.09.23	USD	4	4
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.09.23	AUD	14	14
CAN 5YR BOND FUTURE 18.12.23	CAD	28	28
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23	USD	4	4
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.23	USD	22	22
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	USD	34	34
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	29	29
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	71	71
CAN 5YR BOND FUTURE 19.03.24	CAD	11	0
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	USD	4	0
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	USD	22	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	USD	29	0
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	13	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	71	7

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
MYR	339 000	USD	73 496	06.06.2023
USD	73 496	MYR	339 000	06.06.2023
EUR	85 000	CHF	82 755	06.06.2023
USD	150 000	CHF	136 365	06.06.2023
DKK	2 190 000	CHF	285 399	06.07.2023
NZD	3 810 000	CHF	2 074 933	06.07.2023
JPY	1 630 400 000	CHF	10 638 276	06.07.2023
EUR	18 460 000	CHF	17 966 350	06.07.2023
USD	21 395 000	CHF	19 309 447	06.07.2023
GBP	4 305 000	CHF	4 870 166	06.07.2023
AUD	75 000	CHF	44 912	06.07.2023
CHF	704 212	NOK	8 550 000	06.07.2023
CAD	5 225 000	CHF	3 517 697	06.07.2023
SEK	2 300 000	CHF	194 097	06.07.2023
MXN	18 220 000	CHF	933 167	06.07.2023
ZAR	8 770 000	CHF	406 719	06.07.2023
USD	80 000	CHF	72 344	06.07.2023
AUD	200 000	NZD	218 075	06.07.2023
CHF	136 137	USD	150 000	06.07.2023
EUR	205 000	CHF	198 477	06.07.2023
AUD	200 000	NZD	220 696	06.07.2023
CHF	154 056	USD	170 000	06.07.2023
CHF	97 414	EUR	100 000	06.07.2023
ZAR	1 260 000	USD	66 649	06.07.2023
GBP	105 000	USD	131 732	06.07.2023
USD	135 000	INR	11 143 035	06.07.2023
CHF	226 062	CAD	335 000	06.07.2023
CHF	45 460	MXN	880 000	06.07.2023
USD	144 627	CHF	130 000	06.07.2023
CHF	77 550	EUR	80 000	06.07.2023
USD	34 721	BRL	170 000	06.07.2023
CAD	50 000	USD	37 502	06.07.2023
EUR	64 943	USD	70 000	06.07.2023
CHF	150 959	EUR	155 000	06.07.2023
GBP	50 000	CHF	56 951	06.07.2023
CHF	125 898	USD	140 000	06.07.2023
USD	230 000	CHF	204 942	06.07.2023
AUD	70 000	USD	47 927	06.07.2023
GBP	55 000	CHF	62 670	06.07.2023
EUR	120 000	USD	131 888	06.07.2023
CHF	78 605	EUR	80 000	06.07.2023
CHF	71 513	USD	80 000	06.07.2023
USD	47 211	JPY	6 700 000	06.07.2023
CHF	151 456	AUD	250 000	06.07.2023
CHF	125 642	USD	140 000	06.07.2023
EUR	75 000	CHF	72 995	06.07.2023
USD	95 000	CHF	84 639	06.07.2023
USD	70 000	CHF	62 563	06.07.2023
MYR	339 000	USD	72 552	06.07.2023
INR	22 493 035	USD	274 111	06.07.2023
CHF	62 809	USD	70 000	06.07.2023
USD	316 175	CNY	2 280 000	06.07.2023
CHF	86 330	MXN	1 650 000	06.07.2023
USD	629 694	BRL	3 060 000	06.07.2023
EUR	75 000	USD	81 515	06.07.2023

Verkauf Wahrung	Verkauf Betrag	Kauf Wahrung	Kauf Betrag	Falligkeit
CHF	211 597	USD	235 000	06.07.2023
EUR	66 329	CHF	65 000	06.07.2023
USD	674 660	BRL	3 230 000	06.07.2023
USD	72 583	MYR	339 000	04.08.2023
USD	273 936	INR	22 500 000	04.08.2023
CNY	2 280 000	USD	316 438	04.08.2023
BRL	3 060 000	USD	626 138	04.08.2023
USD	20 530 000	CHF	18 411 407	04.08.2023
JPY	1 623 700 000	CHF	10 090 984	04.08.2023
GBP	4 515 000	CHF	5 123 996	04.08.2023
EUR	18 655 000	CHF	18 197 385	04.08.2023
AUD	295 000	CHF	176 199	04.08.2023
CHF	715 508	NOK	8 550 000	04.08.2023
DKK	2 190 000	CHF	286 868	04.08.2023
MXN	15 690 000	CHF	818 531	04.08.2023
NZD	3 375 000	CHF	1 860 329	04.08.2023
ZAR	10 030 000	CHF	477 893	04.08.2023
SEK	2 300 000	CHF	189 861	04.08.2023
CAD	4 940 000	CHF	3 334 703	04.08.2023
CHF	68 213	EUR	70 000	04.08.2023
USD	385 000	CHF	344 817	04.08.2023
CHF	134 024	USD	150 000	04.08.2023
CHF	108 403	GBP	95 000	04.08.2023
CHF	200 384	USD	225 000	04.08.2023
CHF	126 595	EUR	130 000	04.08.2023
CHF	74 154	NZD	135 000	04.08.2023
NOK	1 460 000	SEK	1 500 578	04.08.2023
USD	135 000	EUR	122 724	04.08.2023
USD	75 000	CHF	66 112	04.08.2023
EUR	80 000	CHF	77 082	04.08.2023
USD	190 000	CHF	163 585	04.08.2023
EUR	95 000	CHF	91 696	04.08.2023
USD	245 000	CHF	210 684	04.08.2023
GBP	60 000	CHF	67 619	04.08.2023
GBP	105 000	CAD	181 584	04.08.2023
CHF	146 126	USD	170 000	04.08.2023
EUR	120 000	GBP	103 919	04.08.2023
EUR	125 000	CHF	120 256	04.08.2023
GBP	95 000	CHF	105 289	04.08.2023
CHF	551 418	USD	640 000	04.08.2023
CHF	77 053	EUR	80 000	04.08.2023
CHF	147 096	USD	170 000	04.08.2023
EUR	58 812	USD	65 000	04.08.2023
CHF	114 690	CAD	175 000	04.08.2023
CHF	90 526	USD	105 000	04.08.2023
USD	180 000	CHF	154 186	04.08.2023
USD	132 037	EUR	120 000	04.08.2023
NZD	216 926	AUD	200 000	04.08.2023
MYR	339 000	USD	74 316	04.08.2023
INR	22 500 000	USD	273 456	04.08.2023
USD	319 552	CNY	2 280 000	04.08.2023
CHF	233 999	USD	270 000	04.08.2023
AUD	220 000	CHF	127 389	04.08.2023
USD	648 236	BRL	3 060 000	04.08.2023
USD	45 000	EUR	40 789	04.08.2023
USD	81 184	JPY	11 600 000	04.08.2023
USD	74 528	MYR	339 000	06.09.2023
CNY	2 280 000	USD	319 820	06.09.2023
USD	273 161	INR	22 500 000	06.09.2023
BRL	3 060 000	USD	644 400	06.09.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
JPY	1 612 100 000	CHF	9 950 399	06.09.2023
EUR	18 575 000	CHF	17 861 384	06.09.2023
GBP	4 580 000	CHF	5 120 004	06.09.2023
USD	20 230 000	CHF	17 671 051	06.09.2023
CAD	4 585 000	CHF	3 012 597	06.09.2023
DKK	2 190 000	CHF	282 594	06.09.2023
MXN	15 690 000	CHF	805 834	06.09.2023
ZAR	10 030 000	CHF	475 583	06.09.2023
SEK	800 000	CHF	65 809	06.09.2023
AUD	315 000	CHF	181 333	06.09.2023
CHF	609 412	NOK	7 090 000	06.09.2023
NZD	3 460 000	CHF	1 849 749	06.09.2023
CHF	50 261	GBP	45 000	06.09.2023
CHF	140 305	USD	160 000	06.09.2023
CHF	82 834	USD	95 000	06.09.2023
NOK	340 000	EUR	30 404	06.09.2023
AUD	35 000	EUR	20 932	06.09.2023
CHF	66 683	GBP	60 000	06.09.2023
CHF	223 097	USD	255 000	06.09.2023
USD	265 000	CHF	231 641	06.09.2023
EUR	65 000	CHF	62 461	06.09.2023
USD	70 000	CHF	61 218	06.09.2023
GBP	30 000	USD	38 206	06.09.2023
CHF	91 699	USD	105 000	06.09.2023
CHF	140 037	USD	160 000	06.09.2023
CHF	115 014	EUR	120 000	06.09.2023
CHF	72 349	GBP	65 000	06.09.2023
CHF	62 365	EUR	65 000	06.09.2023
CHF	118 672	USD	135 000	06.09.2023
CHF	78 790	USD	90 000	06.09.2023
CHF	61 493	GBP	55 000	06.09.2023
CHF	48 382	USD	55 000	06.09.2023
USD	35 000	CHF	30 716	06.09.2023
CHF	122 844	USD	140 000	06.09.2023
GBP	102 295	EUR	120 000	06.09.2023
USD	390 000	CHF	342 903	06.09.2023
EUR	120 000	CHF	114 704	06.09.2023
GBP	70 000	CHF	78 065	06.09.2023
CHF	28 506	JPY	4 700 000	06.09.2023
MYR	339 000	USD	72 931	06.09.2023
AUD	195 000	NZD	212 302	06.09.2023
USD	317 992	CNY	2 280 000	06.09.2023
INR	22 500 000	USD	271 858	06.09.2023
USD	190 000	CHF	166 910	06.09.2023
USD	629 578	BRL	3 060 000	06.09.2023
JPY	40 100 000	CHF	243 832	06.09.2023
GBP	60 000	CHF	67 146	06.09.2023
EUR	90 000	CHF	86 150	06.09.2023
USD	620 463	BRL	3 060 000	06.09.2023
USD	73 108	MYR	339 000	05.10.2023
USD	271 516	INR	22 500 000	05.10.2023
BRL	3 060 000	USD	626 651	05.10.2023
USD	19 935 000	CHF	17 543 416	05.10.2023
CAD	4 585 000	CHF	2 987 466	05.10.2023
CAD	180 547	GBP	105 000	05.10.2023
JPY	1 647 500 000	CHF	9 964 668	05.10.2023
EUR	18 495 000	CHF	17 638 145	05.10.2023
GBP	4 620 000	CHF	5 148 303	05.10.2023
MXN	15 690 000	CHF	803 950	05.10.2023
CHF	558 496	NOK	6 750 000	05.10.2023

Verkauf Wahrung	Verkauf Betrag	Kauf Wahrung	Kauf Betrag	Falligkeit
AUD	545 000	CHF	310 748	05.10.2023
NZD	3 250 000	CHF	1 701 819	05.10.2023
SEK	800 000	CHF	64 070	05.10.2023
DKK	2 190 000	CHF	280 299	05.10.2023
ZAR	10 030 000	CHF	464 425	05.10.2023
CHF	66 749	EUR	70 000	05.10.2023
CHF	189 551	USD	215 000	05.10.2023
JPY	25 400 000	USD	174 293	05.10.2023
USD	125 000	CAD	170 490	05.10.2023
CHF	55 652	GBP	50 000	05.10.2023
CHF	155 359	USD	175 000	05.10.2023
CHF	66 833	EUR	70 000	05.10.2023
INR	10 413 625	USD	125 000	05.10.2023
USD	124 573	GBP	100 000	05.10.2023
CHF	49 012	USD	55 000	05.10.2023
USD	60 000	CHF	53 345	05.10.2023
CAD	169 423	USD	125 000	05.10.2023
USD	42 821	EUR	40 000	05.10.2023
AUD	195 000	NZD	212 315	05.10.2023
GBP	65 000	USD	80 588	05.10.2023
CHF	67 165	USD	75 000	05.10.2023
CHF	85 991	EUR	90 000	05.10.2023
CHF	62 292	EUR	65 000	05.10.2023
INR	12 086 375	USD	145 245	05.10.2023
CHF	81 477	EUR	85 000	05.10.2023
CHF	44 912	JPY	7 400 000	05.10.2023
AUD	199 799	GBP	105 000	05.10.2023
CHF	275 989	USD	305 000	05.10.2023
USD	38 546	BRL	190 000	05.10.2023
CAD	165 000	CHF	111 409	05.10.2023
USD	62 637	NZD	105 000	05.10.2023
CHF	67 689	EUR	70 000	05.10.2023
CHF	159 551	USD	175 000	05.10.2023
MYR	339 000	USD	72 001	05.10.2023
CHF	150 044	EUR	155 000	05.10.2023
CHF	146 867	USD	160 000	05.10.2023
USD	567 194	BRL	2 870 000	05.10.2023
CHF	145 021	EUR	150 000	05.10.2023
USD	67 404	GBP	55 000	05.10.2023
EUR	130 000	CHF	125 347	05.10.2023
CNY	2 280 000	USD	316 096	10.10.2023
USD	319 507	CNY	2 280 000	10.10.2023
CNY	2 280 000	USD	317 558	10.10.2023
CNY	2 280 000	USD	317 505	06.11.2023
USD	72 184	MYR	339 000	06.11.2023
BRL	2 870 000	USD	565 072	06.11.2023
USD	18 860 000	CHF	17 342 204	06.11.2023
EUR	17 830 000	CHF	17 199 282	06.11.2023
JPY	1 665 500 000	CHF	10 270 255	06.11.2023
GBP	4 270 000	CHF	4 737 373	06.11.2023
AUD	940 000	CHF	545 426	06.11.2023
MXN	15 690 000	CHF	811 459	06.11.2023
CHF	570 875	NOK	6 750 000	06.11.2023
DKK	2 190 000	CHF	283 472	06.11.2023
CAD	4 930 000	CHF	3 305 985	06.11.2023
SEK	800 000	CHF	66 479	06.11.2023
NZD	2 935 000	CHF	1 591 384	06.11.2023
ZAR	10 030 000	CHF	476 233	06.11.2023
CHF	66 594	GBP	60 000	06.11.2023
CHF	57 838	EUR	60 000	06.11.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	174 606	USD	190 000	06.11.2023
CHF	219 256	USD	240 000	06.11.2023
CHF	1 553 733	EUR	1 615 000	06.11.2023
USD	180 000	CHF	164 196	06.11.2023
USD	50 000	NZD	84 152	06.11.2023
NZD	210 000	USD	124 956	06.11.2023
MYR	339 000	USD	72 059	06.11.2023
CHF	81 469	USD	90 000	06.11.2023
USD	305 000	CHF	275 800	06.11.2023
EUR	57 887	JPY	9 100 000	06.11.2023
EUR	75 000	CHF	71 597	06.11.2023
GBP	50 000	CHF	55 278	06.11.2023
USD	130 000	CHF	116 778	06.11.2023
CHF	271 603	USD	300 000	06.11.2023
USD	55 052	CAD	75 000	06.11.2023
USD	160 000	CHF	143 877	06.11.2023
USD	31 683	EUR	30 000	06.11.2023
CHF	52 913	NZD	100 000	06.11.2023
USD	36 485	GBP	30 000	06.11.2023
USD	58 353	ZAR	1 100 000	06.11.2023
CHF	60 204	GBP	55 000	06.11.2023
CHF	139 230	USD	155 000	06.11.2023
CHF	219 561	USD	245 000	06.11.2023
CHF	108 997	EUR	115 000	06.11.2023
CHF	66 209	EUR	70 000	06.11.2023
CHF	102 931	USD	115 000	06.11.2023
EUR	120 000	GBP	104 807	06.11.2023
USD	39 199	EUR	37 000	06.11.2023
EUR	74 528	AUD	125 000	06.11.2023
USD	143 655	JPY	21 500 000	06.11.2023
CHF	124 824	USD	140 000	06.11.2023
USD	75 000	CHF	66 848	06.11.2023
USD	65 000	GBP	53 410	06.11.2023
USD	47 387	CNY	340 000	06.11.2023
EUR	40 000	CHF	37 960	06.11.2023
USD	150 000	CHF	133 788	06.11.2023
AUD	190 000	NZD	206 847	06.11.2023
EUR	57 450	JPY	9 100 000	06.11.2023
CHF	228 833	USD	255 000	06.11.2023
USD	180 000	CHF	162 256	06.11.2023
EUR	110 000	CAD	161 176	06.11.2023
USD	580 032	BRL	2 870 000	06.11.2023
USD	271 671	CNY	1 940 000	06.11.2023
GBP	40 000	CHF	43 780	06.11.2023
CHF	791 341	MXN	15 690 000	06.11.2023
EUR	56 987	USD	60 000	06.11.2023
USD	571 781	BRL	2 870 000	06.11.2023
BRL	2 870 000	USD	571 781	06.11.2023
BRL	2 870 000	USD	577 546	06.12.2023
CNY	1 940 000	USD	270 817	06.12.2023
MXN	15 690 000	CHF	784 983	06.12.2023
JPY	1 625 800 000	CHF	9 784 021	06.12.2023
USD	86 968	JPY	13 100 000	06.12.2023
EUR	16 495 000	CHF	15 810 952	06.12.2023
USD	18 625 000	CHF	16 776 016	06.12.2023
CAD	4 695 000	CHF	3 063 557	06.12.2023
DKK	2 190 000	CHF	281 448	06.12.2023
AUD	1 005 000	CHF	583 913	06.12.2023
CHF	545 813	NOK	6 750 000	06.12.2023
GBP	4 060 000	CHF	4 459 569	06.12.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
ZAR	8 930 000	CHF	436 432	06.12.2023
SEK	800 000	CHF	64 885	06.12.2023
NZD	2 755 000	CHF	1 465 778	06.12.2023
USD	190 000	CHF	170 928	06.12.2023
USD	205 000	CHF	183 967	06.12.2023
EUR	105 000	CHF	101 003	06.12.2023
SEK	1 321 007	NOK	1 340 000	06.12.2023
CAD	90 000	CHF	59 000	06.12.2023
USD	215 000	CHF	192 505	06.12.2023
GBP	80 000	CHF	88 765	06.12.2023
EUR	75 000	CHF	72 227	06.12.2023
CHF	23 994	EUR	25 000	06.12.2023
CHF	139 083	USD	155 000	06.12.2023
USD	145 000	CHF	130 147	06.12.2023
USD	105 000	CHF	94 355	06.12.2023
NZD	110 000	CHF	58 601	06.12.2023
EUR	60 000	CHF	57 692	06.12.2023
CHF	234 023	USD	260 000	06.12.2023
JPY	8 200 000	CHF	48 898	06.12.2023
USD	21 361	EUR	20 000	06.12.2023
NZD	200 000	CAD	164 844	06.12.2023
EUR	110 000	GBP	95 925	06.12.2023
USD	370 000	CHF	327 756	06.12.2023
GBP	70 000	CHF	77 172	06.12.2023
EUR	65 000	CHF	62 563	06.12.2023
ZAR	450 000	USD	24 550	06.12.2023
CHF	115 260	USD	130 000	06.12.2023
CAD	164 349	EUR	110 000	06.12.2023
SEK	1 289 301	NOK	1 330 000	06.12.2023
EUR	55 000	CHF	53 011	06.12.2023
USD	135 000	CHF	119 608	06.12.2023
USD	60 000	CHF	52 910	06.12.2023
USD	60 000	BRL	294 198	06.12.2023
EUR	55 000	USD	60 110	06.12.2023
CHF	141 388	USD	160 000	06.12.2023
JPY	7 000 000	CHF	41 599	06.12.2023
GBP	135 000	CHF	149 202	06.12.2023
EUR	30 000	CHF	28 879	06.12.2023
CHF	19 275	EUR	20 000	06.12.2023
EUR	100 000	USD	109 118	06.12.2023
CHF	44 377	GBP	40 000	06.12.2023
CHF	109 950	USD	125 000	06.12.2023
JPY	5 500 000	CHF	32 616	06.12.2023
CHF	144 883	USD	165 000	06.12.2023
USD	273 625	CNY	1 940 000	06.12.2023
CHF	280 420	USD	320 000	06.12.2023
EUR	60 000	CHF	57 717	06.12.2023
USD	525 674	BRL	2 575 802	06.12.2023
USD	165 000	CHF	144 395	06.12.2023
GBP	20 000	CHF	22 147	06.12.2023
EUR	65 000	CHF	62 140	06.12.2023
AUD	30 000	CHF	17 340	06.12.2023
CNY	1 940 000	USD	273 915	05.01.2024
BRL	2 580 000	USD	524 977	05.01.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission:
 - Klasse P: 1,14% p.a.;
 - Klasse Q: 0,60% p.a.;
- Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse P: 1,37% p.a.;
 - Klasse Q: 1,05% p.a.;berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der AMAS in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse P:	1,15%
Klasse Q:	0,61%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 2% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewertungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Bewertungs-Nettoinventarwert einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Bewertungs-Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF 0.58	JPY 1 = CHF 0.01
BRL 1 = CHF 0.18	MXN 1 = CHF 0.05
CAD 1 = CHF 0.64	NOK 1 = CHF 0.08
CNY 1 = CHF 0.12	NZD 1 = CHF 0.54
DKK 1 = CHF 0.13	SEK 1 = CHF 0.08
EUR 1 = CHF 0.95	USD 1 = CHF 0.87
GBP 1 = CHF 1.10	ZAR 1 = CHF 0.05

UBS (CH) Bond Fund – Enhanced Yield Short Term (CHF)

Art Effektenfonds

Wichtigste Daten

	ISIN	30.11.2023	31.5.2023	31.5.2022
Nettofondsvermögen in CHF		285 895 126.44	373 784 034.92	399 687 587.21
Klasse I-A1	CH0589362521			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		96.69	95.74	95.06
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		96.69	96.19	95.06
Anzahl Anteile im Umlauf		434 350,2840	692 349,8600	783 110,9370
Klasse I-B	CH0594826163			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		97.21	96.22	95.42
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		97.21	96.67	95.42
Anzahl Anteile im Umlauf		1 755 676,4610	2 400 977,0100	2 447 920,4700
Klasse I-X	CH0560699891			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		97.63	96.63	95.80
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		97.63	97.08	95.80
Anzahl Anteile im Umlauf		601 170,3260	593 374,8810	913 899,6230
Klasse P	CH0567473944			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		96.80	95.86	95.36
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		96.80	96.31	95.36
Anzahl Anteile im Umlauf		14 554,9820	3 314,0840	9 886,6630
Klasse Q	CH0567473951			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		97.06	96.13	95.44
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		97.06	96.58	95.44
Anzahl Anteile im Umlauf		135 227,6300	195 797,0160	33 310,0460

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

Schweiz	11,06
Vereinigte Staaten von Amerika	7,34
Grossbritannien	6,52
Dänemark	6,24
Frankreich	4,88
Deutschland	4,10
Kanada	3,70
Spanien	3,19
Südkorea	3,19
Australien	2,81
Übrige	17,00
TOTAL	70,03

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.11.2023	31.5.2023
Verkehrswerte	CHF	CHF
Bankguthaben		
– auf Sicht	112 255 768.25 ¹	154 118 077.18 ²
Geldmarktinstrumente	3 992 400.00	0.00
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	274 943 810.96	363 668 242.82
Derivative Finanzinstrumente	3 646 586.86	563 300.27
Sonstige Vermögenswerte	2 086 687.30	2 277 996.40
Gesamtfondsvermögen	396 925 253.37	520 627 616.67
Aufgenommene Kredite	-111 008 038.57	-146 816 540.12
Andere Verbindlichkeiten	-22 088.36	-27 041.63
Nettofondsvermögen	285 895 126.44	373 784 034.92

Erfolgsrechnung

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
Ertrag	CHF	CHF
Erträge der Bankguthaben	62 485.06	25 687.49
Negativzinsen	-6 408.13	-35 847.71
Erträge der Geldmarktinstrumente	-30.00	38 830.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	2 582 243.52	6 318 888.32
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	-45.00	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	5 766.49	165 403.31
TOTAL Ertrag	2 644 011.94	6 512 961.41
Aufwand		
Passivzinsen	-24 465.54	-5 699.10
Prüfaufwand	0.00	-14 684.90
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-56 489.62	-153 625.42
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B	-34 963.62	-80 949.60
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X	0.00	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P	-1 568.77	-874.18
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q	-26 871.60	-19 813.17
Sonstige Aufwendungen	-2 365.62	-4 185.26
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-285 664.59	-511 611.42
TOTAL Aufwand	-432 389.36	-791 443.05
Nettoertrag	2 211 622.58	5 721 518.36
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ³	-4 901 483.16	9 072 330.80
Realisierter Erfolg	-2 689 860.58	14 793 849.16
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	7 426 577.87	-10 043 828.80
Gesamterfolg	4 736 717.29	4 750 020.36

¹ Zum 30. November 2023 wurden von Goldman Sachs Bankguthaben in Höhe von CHF 430 000.00 und von UBS Group AG Bankguthaben in Höhe von CHF 960 000.00 als Sicherheiten entgegengenommen.

² Zum 31. Mai 2023 wurden von Goldman Sachs Bankguthaben in Höhe von CHF 830 000.00 und von UBS Group AG Bankguthaben in Höhe von CHF 1 810 000.00 als Sicherheiten entgegengenommen.

³ Realisierte Kapitalgewinne und -verluste können Aufwendungen und Erträge aus Swinging Single Pricing enthalten.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	373 784 034.92	399 687 587.21
Abgeführte Verrechnungssteuer	-1 798 177.45	-2 040 013.03
Saldo aus dem Anteilverkehr	-90 827 448.32	-28 613 559.62
Gesamterfolg	4 736 717.29	4 750 020.36
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	285 895 126.44	373 784 034.92

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2023-30.11.2023	1.6.2022-31.5.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	692 349,8600	783 110,9370
Ausgegebene Anteile	1 687,3080	7 697,1230
Zurückgenommene Anteile	-259 686,8840	-98 458,2000
Bestand Ende Berichtsperiode	434 350,2840	692 349,8600
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-257 999,5760	-90 761,0770
Klasse I-B		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	2 400 977,0100	2 447 920,4700
Ausgegebene Anteile	0,0000	0,0000
Zurückgenommene Anteile	-645 300,5490	-46 943,4600
Bestand Ende Berichtsperiode	1 755 676,4610	2 400 977,0100
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-645 300,5490	-46 943,4600
Klasse I-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	593 374,8810	913 899,6230
Ausgegebene Anteile	10 276,4930	6 295,2470
Zurückgenommene Anteile	-2 481,0480	-326 819,9890
Bestand Ende Berichtsperiode	601 170,3260	593 374,8810
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	7 795,4450	-320 524,7420
Klasse P		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	3 314,0840	9 886,6630
Ausgegebene Anteile	11 971,8450	4 314,0820
Zurückgenommene Anteile	-730,9470	-10 886,6610
Bestand Ende Berichtsperiode	14 554,9820	3 314,0840
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	11 240,8980	-6 572,5790
Klasse Q		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	195 797,0160	33 310,0460
Ausgegebene Anteile	550,0000	162 486,9700
Zurückgenommene Anteile	-61 119,3860	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	135 227,6300	195 797,0160
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-60 569,3860	162 486,9700

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S STEP-UP 20-22.11.29*	CHF	2 000 000		2 000 000			
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 1.87500% 20-22.11.29*	CHF	200 000		200 000			
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 2.37500% 20-22.11.29*	CHF	200 000		200 000			
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 1.75000% 20-15.06.25*	CHF	300 000		300 000			
SWISSCARD AECS GMBH-REG-S 0.62500% 20-15.06.25*	CHF	300 000		300 000			
SWISSCARD AECS GMBH-REG-S 0.35000% 21-15.06.26*	CHF	505 000		505 000	499 203	0,13	
TOTAL CHF					499 203	0,13	
Total Asset Backed Securities, fester Zins					499 203	0,13	

Notes, fester Zins

CHF							
ALPIQ HOLDING LTD 2.12500% 15-30.06.23*	CHF	1 000 000		1 000 000			
AXPO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 22-04.02.25*	CHF	415 000		415 000	406 368	0,10	
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.05000% 19-09.10.23*	CHF	615 000		615 000			
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF	1 100 000	80 000	1 180 000	1 153 686	0,29	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 434 750	0,36	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.25000% 15-30.04.25*	CHF		600 000	600 000	587 340	0,15	
TESSINER STAATSBANK-REG-S 0.50000% 15-24.06.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
TOTAL CHF					3 582 144	0,90	

EUR							
BANQUE STELLANTIS FRANCE-REG-S 0.62500% 19-21.06.24*	EUR	800 000		800 000	744 793	0,19	
HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-REG-S 0.90000% 19-19.11.24*	EUR	800 000		800 000	734 513	0,18	
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP-REG-S 0.50000% 19-04.07.23*	EUR	1 000 000		1 000 000			
L'OREAL SA-REG-S 0.37500% 22-29.03.24*	EUR	1 000 000		1 000 000	937 694	0,24	
TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA-REG-S 5.62500% 19-02.12.24*	EUR	1 000 000		1 000 000	938 120	0,24	
TOTAL EUR					3 355 121	0,84	

USD							
ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24*	USD	1 000 000		1 000 000	860 223	0,22	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 17-11.09.24*	USD	1 000 000		1 000 000	852 498	0,21	
APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25*	USD	1 750 000	750 000	1 000 000	851 558	0,21	
BAIDU INC 4.37500% 18-14.05.24*	USD	1 000 000		1 000 000	863 811	0,22	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 0.87500% 20-18.09.23*	USD	200 000		200 000			
BANCO SANTANDER SA 2.74600% 20-28.05.25*	USD	2 000 000		1 800 000	1 488 899	0,37	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 3.75000% 18-20.07.23*	USD	1 000 000		1 000 000			
BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25*	USD	1 200 000		1 200 000	1 014 036	0,25	
BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S 4.37500% 14-10.04.24*	USD	1 000 000		1 000 000	861 968	0,22	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24*	USD	1 800 000	500 000	1 300 000	1 083 036	0,27	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.50000% 19-08.04.24*	USD	400 000		400 000	30 434	0,01	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 4.25000% 22-15.06.25*	USD	700 000		700 000	594 778	0,15	
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.20000% 21-15.10.24*	USD	1 500 000		900 000	751 017	0,19	
HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.25000% 14-14.03.24*	USD	500 000		500 000	432 472	0,11	
MACQUARIE BANK LTD-REG-S 3.23100% 22-21.03.25*	USD	1 000 000		1 000 000	845 272	0,21	
MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24*	USD	200 000		200 000	172 668	0,04	
MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75500% 14-11.11.24*	USD	406 000		406 000			
MUFG BANK LTD-REG-S 3.75000% 14-10.03.24*	USD	200 000		200 000	173 029	0,04	
NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-REG-S 6.62500% 18-15.05.25*	USD	500 000		500 000	432 732	0,11	
ORACLE CORP 5.80000% 22-10.11.25*	USD	690 000	300 000	390 000	341 776	0,09	
QUANTA SERVICES INC 0.95000% 21-01.10.24*	USD	1 000 000		1 000 000	834 182	0,21	
SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24*	USD	1 000 000		1 000 000	860 168	0,22	
SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.97500% 21-16.09.23*	USD	400 000		400 000	13 913	0,00	
SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 5.00000% 14-17.01.24*	USD	500 000		500 000	433 737	0,11	
SOCIETE GENERALE-REG-S 2.62500% 19-16.10.24*	USD	900 000		900 000	759 629	0,19	
SOVMBK VIA SO CAP DAC-REG-S *DEFAULTED* 3.40000% 21-26.01.25*	USD	410 000		410 000	8 757	0,00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24*	USD	1 000 000	500 000	500 000	434 132	0,11	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 5.95000% 23-17.07.26*	USD	580 000		580 000	505 307	0,13	
SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25*	USD	867 000		867 000	732 157	0,18	
TAPESTRY INC 7.05000% 23-27.11.25*	USD		1 000 000	1 000 000	880 323	0,22	
TOTAL USD					17 112 511	4,30	
Total Notes, fester Zins					24 049 776	6,04	

Titel		31.5.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.11.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
Notes, variabler Zins								
CHF								
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 1.750%/VAR 21-PRP*	CHF		200 000		200 000	190 500	0,05	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-30.09.41*	CHF	500 000			500 000	450 500	0,11	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP*	CHF	1 600 000			1 600 000	1 414 003	0,35	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.375%/VAR 22-PRP*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 735 000	0,44	
TOTAL CHF						3 790 003	0,95	
EUR								
AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29*	EUR	2 000 000			2 000 000	1 816 982	0,46	
BAYERISCHE LANDESBANK-REG-S-SUB 1.000%/VAR 21-23.09.31*	EUR	700 000			700 000	561 880	0,14	
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S SUB 1.625%/VAR 20-09.06.30*	EUR	1 600 000			1 600 000	1 434 273	0,36	
UBS GROUP AG-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26*	EUR	1 000 000			1 000 000	913 235	0,23	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-SUB 7.250%/VAR 23-PRP*	EUR		1 100 000		1 100 000	957 830	0,24	
TOTAL EUR						5 684 200	1,43	
USD								
BANCO SANTANDER SA 0.701%/VAR 21-30.06.24*	USD	800 000			800 000	694 618	0,17	
CITIGROUP INC 0.776%/VAR 20-30.10.24*	USD	1 000 000			1 000 000	868 889	0,22	
CITIGROUP INC 1.281%/VAR 21-03.11.25*	USD	1 500 000			1 500 000	1 245 210	0,31	
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.222%/VAR 20-18.09.24*	USD	1 404 000		1 404 000				
ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP*	USD	700 000		700 000				
SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.089%/VAR 21-15.03.25*	USD	2 000 000			2 000 000	1 709 989	0,43	
STANDARD CHARTERED PLC-144A 0.991%/VAR 21-12.01.25*	USD	1 000 000			1 000 000	864 089	0,22	
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 1.822%/VAR 21-23.11.25*	USD		1 500 000		1 500 000	1 246 157	0,31	
TOTAL USD						6 628 953	1,66	
Total Notes, variabler Zins						16 103 156	4,04	
Medium-Term Notes, fester Zins								
AUD								
BARCLAYS PLC-REG-S 3.25000% 19-26.06.24*	AUD	1 250 000			1 250 000	711 563	0,18	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 6.25000% 13-08.11.23*	AUD	428 000		428 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 4.50000% 15-05.06.25*	AUD	690 000			690 000	388 781	0,10	
QANTAS AIRWAYS LTD 4.40000% 16-10.10.23*	AUD	1 250 000		1 250 000				
SOCIETE GENERALE-REG-S 3.92500% 18-20.09.23*	AUD	400 000		400 000				
VICINITY CENTRES TRUST 3.50000% 17-26.04.24*	AUD	400 000			400 000	229 135	0,06	
TOTAL AUD						1 329 478	0,33	
CHF								
ABN AMRO BANK NV 1.50000% 12-18.07.23*	CHF	500 000		500 000				
ABN AMRO BANK NV 2.30000% 23-26.06.25*	CHF		1 400 000	1 000 000	400 000	402 000	0,10	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.72500% 18-15.02.24*	CHF	2 685 000			2 685 000	2 673 992	0,67	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24*	CHF	550 000			550 000	539 000	0,14	
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23*	CHF	3 130 000			3 130 000	3 125 305	0,78	
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23*	CHF	300 000		300 000				
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24*	CHF	400 000			400 000	390 240	0,10	
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF		1 400 000		1 400 000	1 305 920	0,33	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF	965 000			965 000	907 583	0,23	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF	880 000			880 000	830 280	0,21	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24*	CHF	500 000			500 000	490 100	0,12	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24*	CHF	495 000			495 000	487 922	0,12	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.75000% 17-12.06.23*	CHF	1 775 000		1 775 000				
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24*	CHF	400 000		400 000				
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.20000% 19-19.11.27*	CHF		1 000 000		1 000 000	935 000	0,23	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	1 921 000	0,48	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 0.27800% 22-01.04.27*	CHF		200 000		200 000	191 600	0,05	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.04250% 23-04.05.26*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 515 000	0,38	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.00000% 14-22.05.24*	CHF	500 000			500 000	500 000	0,13	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 0.55000% 15-08.12.23*	CHF	2 100 000			2 100 000	2 099 580	0,53	
BAWAG PSK BK FR ARBEIT WIRT O-REG-S 1.58500% 23-16.12.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 992 000	0,50	
BERLIN HYP AG 0.37500% 22-21.02.25*	CHF	1 500 000		1 000 000	500 000	490 750	0,12	
BERLIN HYP AG-REG-S 0.96750% 22-04.08.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 968 000	0,49	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24*	CHF	965 000		965 000				
BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28*	CHF	800 000			800 000	748 800	0,19	
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF	2 410 000		2 410 000				
CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATION-REG-S 0.25000% 18-30.05.25*	CHF	100 000	1 000 000	1 000 000	100 000	97 950	0,02	

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAD-REG-S 0.12500% 15-22.12.25*	CHF	2 500 000			2 423 750	0,61	
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.15000% 18-31.07.23*	CHF	600 000		600 000			
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.96750% 22-26.04.29*	CHF		200 000		194 400	0,05	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF	1 000 000		1 000 000			
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24*	CHF	1 100 000			1 081 850	0,27	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF	2 000 000			1 982 000	0,50	
CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26*	CHF	1 700 000			1 652 400	0,41	
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.11750% 20-17.07.25*	CHF	600 000		600 000	584 400	0,15	
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.20000% 19-25.03.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.40500% 20-25.06.25*	CHF		1 750 000		1 702 750	0,43	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.37500% 22-29.09.26*	CHF	1 500 000	100 000		1 629 600	0,41	
COMMERZBANK AG-REG-S 3.26250% 23-03.02.27*	CHF	600 000		600 000	608 700	0,15	
COMMONWEALTH BANK OF AUS-REG-S 0.87500% 22-02.09.25*	CHF	1 725 000		1 725 000	1 700 850	0,43	
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.90300% 23-16.06.28*	CHF		200 000		203 400	0,05	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 2.00000% 14-05.02.24*	CHF		1 500 000		1 499 100	0,38	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	1 560 000		1 560 000			
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 1.12500% 14-05.06.24*	CHF		970 000		966 605	0,24	
CREDIT AGRICOLE SA 2.50750% 23-27.04.27*	CHF	400 000			408 800	0,10	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	500 000		500 000			
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF		800 000		766 800	0,19	
CREDIT AGRICOLE SAVLONDON-SUB 2.12500% 15-29.09.25*	CHF		100 000		100 250	0,03	
CREDIT AGRICOLE SAVLONDON-REG-S 0.62500% 17-12.07.24*	CHF	500 000		500 000	495 800	0,12	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 15-19.12.23*	CHF	600 000			599 460	0,15	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 3.64500% 23-27.01.29*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 642 400	0,41	
DNB BANK ASA-REG-S 0.12500% 18-30.11.23*	CHF	2 000 000		2 000 000			
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24*	CHF	1 440 000		1 440 000			
DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24*	CHF	2 500 000			2 491 250	0,63	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.17000% 17-18.07.25*	CHF	500 000	2 600 000		3 022 500	0,76	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.38250% 18-11.07.24*	CHF		1 000 000	1 000 000			
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23*	CHF	900 000		900 000			
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF	1 000 000			947 000	0,24	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF	400 000		400 000	389 800	0,10	
FORD MOTOR CREDIT CO-REG-S 2.12500% 20-04.12.23*	CHF	2 500 000			2 500 000	0,63	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.50000% 17-04.12.24*	CHF		600 000		591 180	0,15	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 573 600	0,40	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	3 435 000		3 435 000	3 408 894	0,86	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 584 800	0,40	
HYPO NOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24*	CHF	1 000 000	800 000		1 766 520	0,44	
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.45000% 18-05.03.24*	CHF	495 000		495 000			
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.50000% 22-07.04.27*	CHF	1 000 000			963 000	0,24	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.02190% 19-16.07.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	968 000	0,24	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL-REG-S 3.25000% 07-28.06.24*	CHF		785 000		789 710	0,20	
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24*	CHF	1 900 000		1 900 000	1 866 370	0,47	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.80000% 22-03.02.32*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 706 414	0,68	
KOMMUNALBANKEN A/S-REG-S 1.27500% 22-22.12.27*	CHF		200 000	200 000	199 400	0,05	
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.30300% 18-14.06.23*	CHF	1 000 000		1 000 000			
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25*	CHF	845 000		845 000			
KOREA DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 0.94000% 22-28.04.27*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 660 900	0,42	
KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 0.25000% 17-07.06.24*	CHF		3 705 000		3 669 432	0,92	
KOREA GAS CORP-REG-S 0.20750% 18-02.08.23*	CHF	2 500 000		2 500 000			
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.10000% 18-08.05.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
MACQUARIE BANK-REG-S 0.75000% 16-05.02.24*	CHF	2 955 000		2 955 000			
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.30000% 17-19.01.26*	CHF	300 000			290 550	0,07	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.15000% 22-07.12.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 025 000	0,51	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.35000% 18-12.12.23*	CHF	1 565 000		1 565 000	1 564 374	0,39	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.37500% 22-07.04.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	973 000	0,24	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.50000% 14-07.02.24*	CHF	3 000 000		3 000 000			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 18-13.03.24*	CHF	1 500 000		1 500 000			
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2.97000% 23-08.09.27*	CHF		600 000		609 900	0,15	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	985 200	0,25	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 17-25.03.24*	CHF	2 000 000		2 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 18-12.05.27*	CHF		2 250 000		2 168 325	0,54	
QNB FINANCE LTD-REG-S 0.02500% 21-03.06.24*	CHF	600 000		600 000	592 584	0,15	
RCI BANQUE SA-REG-S 0.50000% 19-18.07.24*	CHF	360 000		360 000	355 392	0,09	
RCI BANQUE SA-REG-S 3.50000% 23-10.05.28*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 567 500	0,39	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.40000% 22-05.10.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	967 500	0,24	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.49500% 22-08.07.25*	CHF	3 000 000	1 000 000	2 000 000	1 992 000	0,50	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.44500% 23-25.01.28*	CHF	500 000		500 000	511 000	0,13	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.15000% 19-10.12.24*	CHF	800 000		800 000	784 080	0,20	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.73250% 23-04.07.25*	CHF		2 000 000		2 032 000	0,51	
SANTANDER UK PLC-REG-S 2.01000% 23-12.09.26*	CHF		1 200 000		1 215 600	0,31	

Titel			31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
			Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.38500% 21-22.07.26*	CHF	1 800 000			1 800 000		1 710 000	0,43	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF	1 000 000			1 000 000		935 000	0,23	
SOCIETE GENERALE SA 2.27750% 23-27.02.26*	CHF	800 000			800 000		807 600	0,20	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.62500% 22-14.10.26*	CHF	800 000			800 000		816 400	0,20	
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.87500% 19-28.02.24*	CHF	1 400 000		1 000 000	400 000		398 640	0,10	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 1.62500% 14-01.11.24*	CHF	1 800 000			1 800 000		1 785 600	0,45	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.15000% 21-26.04.24*	CHF	1 000 000			1 000 000		975 900	0,25	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 21-16.08.23*	CHF	1 000 000		1 000 000					
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.97000% 23-18.09.26*	CHF		1 000 000		1 000 000		1 010 500	0,25	
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.000001% 21-21.05.24*	CHF	800 000			800 000		791 129	0,20	
UBS AG, LONDON BRANCH-REG-S 2.33000% 22-14.11.25*	CHF	400 000			400 000		403 200	0,10	
WESTPAC BANKING CORP 0.40000% 15-09.06.23*	CHF	1 660 000		1 660 000					
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.40000% 18-06.06.24*	CHF	650 000		650 000					
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON-REG-S 0.37500% 16-05.02.24*	CHF	2 400 000		2 400 000					
WOODSIDE FINANCE LTD-REG-S 1.00000% 16-11.12.23*	CHF	300 000			300 000		299 910	0,08	
TOTAL CHF							103 521 989	25,99	

EUR

ASB BANK LTD-REG-S 4.50000% 23-16.03.27*	EUR	1 005 000			1 005 000		969 912	0,24	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.37500% 19-02.10.24*	EUR	1 200 000			1 200 000		1 105 550	0,28	
BNP PARIBAS SA-REG-S 1.12500% 18-11.06.26*	EUR	1 700 000			1 700 000		1 515 864	0,38	
BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-REG-S 0.50000% 19-12.09.25*	EUR	800 000			800 000		716 091	0,18	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26*	EUR		750 000		750 000		575 578	0,14	
CTP BV-REG-S 0.62500% 20-27.11.23*	EUR	700 000		700 000					
CTP BV-REG-S 2.12500% 20-01.10.25*	EUR		1 000 000		1 000 000		897 286	0,23	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 1.62500% 21-16.11.23*	EUR	1 500 000		1 500 000					
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.12500% 21-16.02.26*	EUR	1 000 000			1 000 000		864 867	0,22	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.25000% 16-01.05.25*	EUR	1 700 000			1 700 000		1 551 518	0,39	
INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.15000% 17-18.07.24*	EUR	1 000 000			1 000 000		936 347	0,24	
LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 0.75000% 19-15.07.24*	EUR	1 000 000			1 000 000		921 157	0,23	
MORGAN STANLEY 1.37500% 16-27.10.26*	EUR	2 000 000		500 000	1 500 000		1 330 673	0,33	
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S 0.50000% 20-12.08.25*	EUR	800 000			800 000		718 406	0,18	
SCHAEFFLER AG-REG-S 1.87500% 19-26.03.24*	EUR	1 000 000		500 000	500 000		470 251	0,12	
SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 0.01000% 20-10.09.25*	EUR	2 500 000			2 500 000		2 216 977	0,56	
TOTAL EUR							14 790 475	3,71	

USD

CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 3.25000% 17-04.10.24*	USD	1 000 000			1 000 000		851 389	0,21	
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24*	USD	200 000			200 000		172 983	0,04	
LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25*	USD	1 000 000			1 000 000		869 967	0,22	
MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 19-07.11.24*	USD	1 100 000			1 100 000		925 882	0,23	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 4.25000% 18-14.09.23*	USD	200 000		200 000					
UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 3.05900% 22-07.04.25*	USD	800 000		400 000	400 000		338 602	0,09	
TOTAL USD							3 158 824	0,79	
Total Medium-Term Notes, fester Zins							122 800 766	30,83	

Medium-Term Notes, Nullcoupon

CHF

CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24*	CHF	800 000			800 000		783 760	0,20	
KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24*	CHF		1 200 000		1 200 000		1 177 200	0,30	
TOTAL CHF							1 960 960	0,49	

EUR

ALLIANZ FINANCE II BV-REG-S 0.00000% 20-14.01.25*	EUR	900 000		900 000					
BECTON DICKINSON AND CO 0.00000% 21-13.08.23*	EUR	1 000 000		1 000 000					
TOTAL EUR								0,00	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon							1 960 960	0,49	

Medium-Term Notes, variabler Zins

AUD

FIRST ABU DHABI BANK PJSC 3M BBSW+110BP 20-18.02.25*	AUD	400 000			400 000		230 117	0,06	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 3M BBSW+140BP 18-07.03.25*	AUD	1 150 000			1 150 000		663 834	0,17	
TOTAL AUD							893 951	0,22	

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
EUR								
ALLIANZ SE-REG-S-SUB 4.750%/3M EURIBOR+360BP 13-PRP*	EUR	900 000		900 000				
AVIVA PLC-REG-S-SUB 3.375%/VAR 15-04.12.45*	EUR	1 000 000			1 000 000	915 525	0,23	
IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP*	EUR	1 900 000			1 900 000	1 788 944	0,45	
ING GROEP NV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 17-15.02.29*	EUR	1 700 000			1 700 000	1 603 193	0,40	
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 1.750%/VAR 18-07.09.28*	EUR	1 700 000		1 700 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB 2.000%/VAR 17-25.07.29*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 110 043	0,28	
NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 18-04.03.25*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 131 092	0,28	
ORANGE SA-REG-S-SUB 2.375%/VAR 19-PRP*	EUR	300 000			300 000	274 295	0,07	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-REG-S-SUB 1.375%/VAR 16-31.10.28*	EUR	1 500 000		1 500 000				
TOTAL EUR						6 823 091	1,71	

GBP

INTERCONTINENTAL HTLS-REG-S 3.750%/RATING LINKED 15-14.08.25*	GBP	501 000			501 000	531 453	0,13	
TOTAL GBP						531 453	0,13	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						8 248 495	2,07	

Anleihen, fester Zins

CHF

AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.06000% 16-01.07.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02000% 16-17.10.24*	CHF	1 000 000			1 000 000			
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.11000% 17-21.02.24*	CHF	1 175 000						
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.35000% 22-24.03.27*	CHF	870 000			870 000	837 810	0,21	
ALPIQ HOLDING AG 1.75000% 22-24.06.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	988 500	0,25	
AMAG LEASING AG 0.17500% 21-16.06.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	965 000	0,24	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.25000% 21-27.10.23*	CHF	1 300 000		1 300 000				
AMAG LEASING AG-REG-S 0.21000% 21-27.06.24*	CHF	865 000			865 000	852 804	0,21	
APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24*	CHF	3 000 000		3 000 000				
BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23*	CHF	3 945 000		3 945 000				
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	1 250 000			1 250 000	1 248 375	0,31	
BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 2.87000% 22-03.10.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 008 500	0,25	
BANK OF MONTREAL 2.03750% 23-27.04.28*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 836 000	0,46	
BANK OF MONTREAL-REG-S 0.09600% 20-22.12.23*	CHF	200 000		200 000				
BANK OF NOVA SCOTIA 0.29500% 22-25.04.25*	CHF	2 000 000			2 000 000			
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75000% 11-22.11.24*	CHF	1 050 000			1 050 000			
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 18-11.04.24*	CHF	1 000 000			1 000 000			
BKW AG-REG-S 0.75000% 18-15.10.25*	CHF	200 000			200 000	196 300	0,05	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE-REG-S 1.71250% 22-13.07.27*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 012 000	0,76	
CLARIANT AG-REG-S 2.12500% 14-17.10.24*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 496 250	0,38	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.30000% 17-07.04.25*	CHF		1 000 000	1 000 000				
DBS BANK LTD-REG-S 1.51500% 22-12.12.25*	CHF	2 000 000	200 000		2 200 000	2 191 200	0,55	
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23*	CHF	1 000 000			1 000 000			
DIGITAL INTREPID HOLDING B-REG-S 0.60000% 22-02.10.23*	CHF	2 500 000			2 500 000			
DUFREY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26*	CHF	425 000			425 000	416 819	0,10	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.57800% 19-11.03.24*	CHF	1 855 000			1 855 000	1 841 830	0,46	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.55000% 15-03.02.25*	CHF	3 500 000		3 500 000				
GEBERIT AG-REG-S 2.25000% 23-26.09.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.40000% 18-30.11.26*	CHF		300 000		300 000	289 500	0,07	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.12500% 18-29.05.24*	CHF	2 000 000			2 000 000			
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 16-04.07.23*	CHF	2 100 000			2 100 000			
HYPOTHEKENBANK FRANKFURT INTL-REG-S 2.50000% 05-29.08.25*	CHF	2 000 000	100 000		2 100 000	2 125 200	0,53	
KAZAKHSTAN TEMIR ZHO NATI CO JSC-REG-S 3.25000% 18-05.12.23*	CHF	650 000			650 000	640 250	0,16	
KOREA HOUSING FINANCE CORP 1.81500% 23-10.02.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 002 000	0,50	
LLOYDS BANK PLC-REG-S 1.87000% 23-31.08.27*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 012 500	0,25	
MONDELEZ INTL-REG-S 1.12500% 15-30.12.25*	CHF		1 600 000	1 000 000	600 000	591 000	0,15	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY REG-S 0.91940% 22-17.12.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 969 000	0,49	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.75750% 23-23.01.26*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 500 000	0,38	
NESTLE SA 1.62500% 22-07.11.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 004 000	0,50	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 2.62500% 14-17.06.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 000 000	0,25	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.37500% 21-27.11.25*	CHF	950 000			950 000	909 150	0,23	
ORIOR AG-REG-S 0.62500% 17-26.09.23*	CHF	1 050 000		1 050 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.25000% 13-29.09.23*	CHF	1 000 000			1 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 14-23.08.24*	CHF	500 000			500 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 15-24.01.25*	CHF		3 450 000	3 450 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 15-12.03.24*	CHF	1 000 000			1 000 000			
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.37500% 15-30.08.23*	CHF	1 200 000			1 200 000			
RIETER HOLDING AG-REG-S 1.55000% 20-17.09.24*	CHF	1 500 000	100 000		1 600 000	1 588 000	0,40	
STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 20-03.10.23*	CHF	1 000 000			1 000 000			
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF	550 000		550 000				

Titel			31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
			Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.04000% 23-26.01.26*	CHF	385 000			385 000		387 310	0,10	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24*	CHF	2 425 000		2 425 000					
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23*	CHF	325 000		325 000					
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24*	CHF	1 000 000			1 000 000		983 800	0,25	
TEMENOS AG-REG-S 1.87500% 18-30.11.23*	CHF	1 800 000		1 800 000					
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.20000% 16-19.08.24*	CHF	1 500 000			1 500 000		1 480 500	0,37	
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.48000% 22-21.09.26*	CHF	1 500 000	800 000		2 300 000		2 295 400	0,58	
ZUGER KANTONALBANK AG 1.50000% 11-28.11.23*	CHF	200 000		200 000					
ZUR ROSE GROUP AG-REG-S 2.50000% 19-21.11.24*	CHF	2 000 000		2 000 000					
TOTAL CHF							37 668 997	9,46	

DKK

DLR KREDIT A/S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 292 580	0	39 600	1 252 980		128 792	0,03	
DLR KREDIT A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	6 102 213		104 695	5 997 518		554 092	0,14	
DLR KREDIT A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 941 877		1 386	4 940 491		444 334	0,11	
JYSKE REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	6 064 005		102 451	5 961 554		556 459	0,14	
JYSKE REALKREDIT A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 788 687		9 637	4 779 050		419 628	0,11	
JYSKE REALKREDIT A/S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 272 669		39 304	1 233 365		124 213	0,03	
JYSKE REALKREDIT A/S 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	7 365 814		141 311	7 224 503		638 490	0,16	
JYSKE REALKREDIT A/S 3.00000% 22-01.10.53*	DKK	14 938 923		31 899	14 907 024		1 657 303	0,42	
JYSKE REALKREDIT A/S 3.00000% 22-01.10.53*	DKK	14 699 038		167 930	14 531 108		1 652 272	0,41	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.50000% 19-01.10.50*	DKK	6 104 416		4 424	6 099 992		577 392	0,14	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	6 061 369		106 588	5 954 781		555 827	0,14	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 814 553		2 108	4 812 445		423 019	0,11	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	875		1	874		72	0,00	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	0			0			0,00	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.50000% 21-01.10.53*	DKK	4 999 364		470	4 998 894		458 492	0,12	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 5.00000% 22-01.10.53*	DKK	20 000 000		5 664	19 994 336		2 521 473	0,63	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	11 989 029		11 989 029					
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 287 995		37 939	1 250 056		125 510	0,03	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	12 726 589		12 726 589					
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	6 915 793		12 840	6 902 953		594 260	0,15	
NYKREDIT REALKREDIT AS-REG-S 3.50000% 22-01.10.53*	DKK	3 941 608		41 199	3 900 409		461 601	0,12	
NYKREDIT REALKREDIT AS-REG-S 4.00000% 22-01.10.53*	DKK	3 953 848		37 314	3 916 534		479 458	0,12	
NYKREDIT REALKREDIT AS-REG-S 5.00000% 22-01.10.53*	DKK	20 000 000		47 046	19 952 954		2 514 350	0,63	
NYKREDIT REALKREDIT A/S 3.00000% 12-01.10.44*	DKK	3 339 720		47 106	3 292 614		402 869	0,10	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	1 326 118		22 663	1 303 455		121 666	0,03	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 800 999		10 476	4 790 523		420 635	0,11	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 278 821		38 238	1 240 583		124 480	0,03	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	6 458 739		120 137	6 338 602		559 590	0,14	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	6 906 547		13 747	6 892 800		593 421	0,15	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	1 980 364		2 480	1 977 884		147 934	0,04	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.50000% 21-01.10.53*	DKK	4 802 726		69 339	4 733 387		461 095	0,12	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 3.00000% 22-01.10.53*	DKK	16 669 119		192 118	16 477 001		1 870 113	0,47	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 4.00000% 22-01.10.53*	DKK	3 985 974		9 701	3 976 273		481 483	0,12	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 2.50000% 14-01.10.47*	DKK	23 533 265		149 158	23 384 107		2 618 201	0,66	
TOTAL DKK							22 688 525	5,70	

EUR

ACCOR SA-REG-S STEP-UP 17-25.01.24*	EUR	1 800 000		500 000	1 300 000		1 228 230	0,31	
WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 0.45200% 19-25.09.23*	EUR	1 700 000		1 700 000					
TOTAL EUR							1 228 230	0,31	

USD

COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 4.50000% 15-09.12.25*	USD	1 000 000			1 000 000		849 107	0,21	
MIZUHO FINANCE GRP CAY 3 LTD-REG-S-SUB 4.60000% 14-27.03.24*	USD	1 000 000			1 000 000		864 609	0,22	
UBS AG-REG-S-SUB 5.12500% 14-15.05.24*	USD	200 000			200 000		171 954	0,04	
TOTAL USD							1 885 670	0,47	

Total Anleihen, fester Zins							63 471 423	15,93	
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-------------------	--------------	--

Anleihen, Nullcoupon

CHF

KOREA GAS CORP-REG-S 0.00000% 19-28.11.23*	CHF	500 000		500 000					
KOREA RAILROAD CORP-REG-S 0.00000% 19-13.06.25*	CHF		200 000		200 000		194 300	0,05	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24*	CHF	650 000		650 000					
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 15-25.07.23*	CHF	1 000 000		1 000 000					
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-14.06.24*	CHF	1 000 000		1 000 000					
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-02.10.26*	CHF	1 000 000		1 000 000					

Titel		31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
		Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.10.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 931 000	0,48	
TOTAL CHF						2 125 300	0,53	

EUR

BANK JULIUS BAER & CO AG-REG-S 0.00000% 21-25.06.24*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 388 695	0,35	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 21-15.05.26*	EUR	3 200 000			3 200 000	2 783 786	0,70	
TOTAL EUR						4 172 480	1,05	
Total Anleihen, Nullcoupon						6 297 780	1,58	

Anleihen, variabler Zins

CHF

BANK CLER AG-SUB 3.000%/VAR 20-PRP*	CHF	750 000	500 000		1 250 000	1 018 125	0,26	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 2.500%/VAR 19-PRP*	CHF	800 000			800 000	624 000	0,16	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 844 000	0,71	
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FIN-REG-S-SUB 3.500%/VAR 18-PRP*	CHF	600 000			600 000	598 980	0,15	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	710 000	0,18	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	922 500	0,23	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 773 000	0,45	
ZUERCHER KANTONALBANK-SUB 2.125%/VAR 17-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	988 500	0,25	
TOTAL CHF						9 479 105	2,38	

EUR

AXA SA-REG-S-SUB 5.125%/3M EURIBOR+435BP 13-04.07.43*	EUR	800 000		800 000				
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S-SUB 0.950%/VAR 19-PRP*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 251 897	0,31	
ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 400 023	0,35	
ENBW ENERGIE BADEN-WUERTT-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-05.11.79*	EUR	2 000 000			2 000 000	1 832 507	0,46	
SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP*	EUR	200 000			200 000	169 484	0,04	
UBS GROUP AG-REG-S 1.250%/VAR 18-17.04.25*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 030 430	0,26	
UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP*	EUR	1 200 000		1 200 000				
TOTAL EUR						5 684 341	1,43	

USD

BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP*	USD	1 900 000		300 000	1 600 000	1 340 468	0,34	
NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP*	USD	200 000			200 000	162 954	0,04	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP*	USD	600 000			600 000	495 137	0,12	
VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78*	USD	200 000		200 000				
TOTAL USD						1 998 559	0,50	
Total Anleihen, variabler Zins						17 162 005	4,31	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						260 593 563	65,42	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Asset Backed Securities, fester Zins

USD

MMAF EQUIPMENT FINANCE LLC-144A 3.61000% 18-10.03.42*	USD	155 000		155 000				
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROG-144A 2.65000% 17-25.09.40*	USD	1 000 000			1 000 000	99 642	0,03	
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.59000% 18-25.01.48*	USD	200 000			200 000	39 596	0,01	
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.60000% 18-25.02.48*	USD	200 000			200 000	38 017	0,01	
TOTAL USD						177 255	0,04	
Total Asset Backed Securities, fester Zins						177 255	0,04	

Mortgage Backed Securities, fester Zins

USD

BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE-144A 3.21800% 15-01.04.33*	USD	1 000 000			1 000 000	820 408	0,21	
BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE-144A 3.49000% 15-01.04.33*	USD	190 000		190 000				
BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33*	USD	1 200 000			1 200 000	963 290	0,24	
COMM 2015-CRE23 MORTGAGE TRUST 3.80100% 15-01.05.48*	USD	1 500 000			1 500 000	1 237 378	0,31	
ONE MARKET PLAZA TRUST 2017-1MKT-144A 3.61390% 17-01.02.32*	USD	500 000		500 000				
TOTAL USD						3 021 076	0,76	
Total Mortgage Backed Securities, fester Zins						3 021 076	0,76	

Titel	31.5.2023		30.11.2023		Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
	Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	Anzahl/ Nominal			
Mortgage Backed Securities, variabler Zins							
USD							
CITYLINE COMMERCIAL MORTGAGE TST-144A 2.778%/VAR 21-01.11.31*	USD	1 500 000		1 500 000			
COMMERCIAL MORTGAGE PASS-THR-144A 3.812163%/VAR 13-01.06.46*	USD	1 000 000		1 000 000			
MAD MORTGAGE TRUST-144A 2.975%/VAR 17-01.08.34*	USD	1 600 000		1 600 000	1 238 239	0,31	
MAD MORTGAGE TRUST-144A 3.141%/VAR 17-01.08.34*	USD	500 000		500 000			
TOTAL USD					1 238 239	0,31	
Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins					1 238 239	0,31	

Notes, fester Zins

USD							
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BNK-REG-S-SUB 4.50000% 14-19.03.24*	USD	750 000		750 000	648 853	0,16	
NXP BV / NXP FUNDING LLC 4.87500% 22-01.03.24*	USD	985 000		985 000	852 858	0,21	
TOTAL USD					1 501 711	0,38	
Total Notes, fester Zins					1 501 711	0,38	

Notes, variabler Zins

USD							
DANSKE BANK A/S-144A 3.773%/VAR 22-28.03.25*	USD	3 000 000	500 000	2 500 000	2 155 566	0,54	
ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26*	USD	750 000		750 000	634 203	0,16	
TOTAL USD					2 789 769	0,70	
Total Notes, variabler Zins					2 789 769	0,70	

Medium-Term Notes, fester Zins

AUD							
AIR NEW ZEALAND LTD 5.70000% 22-25.05.26*	AUD		290 000	90 000	200 000	114 995	0,03
NBN CO LTD-REG-S 1.00000% 20-03.12.25*	AUD	2 000 000			2 000 000	1 062 303	0,27
TOTAL AUD						1 177 298	0,30

USD							
BRIGHTHOUSE FINANCIAL GLOBAL FUND-REG-S 0.60000% 21-28.06.23*	USD	800 000		800 000			
TOTAL USD						0,00	
Total Medium-Term Notes, fester Zins					1 177 298	0,30	

Medium-Term Notes, variabler Zins

USD							
BANK OF NEW YORK MELLON/THE 5.224%/VAR 22-21.11.25*	USD	500 000		500 000	433 045	0,11	
TOTAL USD					433 045	0,11	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins					433 045	0,11	

Anleihen, variabler Zins

USD							
BANCO BILBAO VIZCA ARGATARIA SA 5.862%/VAR 14.09.22-14.09.26*	USD	1 000 000		1 000 000	865 912	0,22	
SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80*	USD	936 000		678 000	258 000	0,05	
TOTAL USD					1 073 974	0,27	
Total Anleihen, variabler Zins					1 073 974	0,27	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden					11 412 368	2,87	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF							
EMIRATES NBD BANK PJSC 0.17000% 21-08.11.24**	CHF	2 000 000		2 000 000	1 955 940	0,49	
TOTAL CHF					1 955 940	0,49	
Total Medium-Term Notes, fester Zins					1 955 940	0,49	

Titel		31.5.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.11.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal
Medium-Term Notes, variabler Zins								
AUD								
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3M BBSW+93BP 18-16.08.23**	AUD	600 000		600 000				
TOTAL AUD							0,00	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins							0,00	

Anleihen, fester Zins

CHF								
UBS AG/LONDON 0.71000% 22-13.04.25**	CHF	1 000 000			1 000 000	981 940	0,25	
TOTAL CHF							981 940	0,25
Total Anleihen, fester Zins							981 940	0,25
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						2 937 880	0,74	

Nicht-Effekten

Treasury-Bills, Nullcoupon

CHF								
SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 12.10.23-11.01.24**	CHF	5 000 000	1 000 000	4 000 000		3 992 400	1,00	
TOTAL CHF							3 992 400	1,00
Total Treasury-Bills, Nullcoupon							3 992 400	1,00
Total Nicht-Effekten							3 992 400	1,00
Total Wertschriften							278 936 211	70,03
(davon ausgeliehen)								0,00
Bankguthaben auf Sicht						112 255 768	28,53	
Derivative Finanzinstrumente						3 646 587	0,92	
Sonstige Vermögenswerte						2 086 687	0,52	
Gesamtfondsvermögen						396 925 253	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-111 008 039		
Andere Verbindlichkeiten						-22 088		
Nettofondsvermögen						285 895 126		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.11.2023	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	271 796 038	68,24
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	10 786 760	2,71
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
TOTAL	282 582 798	70,95

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/ Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.23*	-200	EUR	-19 997 141	-34 156	-0.01
EURO-BUND FUTURE 07.12.23*	-85	EUR	-10 668 542	-60 484	-0.02
EURO-BOBL FUTURE 07.12.23*	-96	EUR	-10 702 081	-68 311	-0.02
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24*	-50	USD	-8 889 450	-31 250	-0.01
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24*	-30	USD	-2 787 383	-15 692	0.01
			-53 044 597	-209 893	-0.05

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/ Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.49600% 21-09.09.26**	15 000 000	CHF	15 000 000	784 005	0.20
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-09.09.26	15 000 000	CHF			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.45800% 21-25.10.24**	20 000 000	CHF	20 000 000	411 560	0.10
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-25.10.24	20 000 000	CHF			
GS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.11000% 22-20.06.25**	33 000 000	CHF	33 000 000	242 461	0.06
GS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-20.06.25	33 000 000	CHF			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.78700% 23-28.08.26**	25 000 000	CHF	25 000 000	-382 068	-0.09
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-28.08.26	25 000 000	CHF			
			93 000 000	1 055 958	0.27

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
ICE/ITRX.XOVER S40 V1 CDI REC 5.00000% 23-20.12.28**	1 500 000	EUR	1 511 393	88 244	0.02
			1 511 393	88 244	0.02

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	48 515 000	CHF	46 466 697	04.12.2023	437 314	0.11
GBP	475 000	CHF	520 427	04.12.2023	-2 457	0.00
USD	47 475 000	CHF	42 691 656	04.12.2023	1 409 770	0.35
AUD	6 395 000	CHF	3 665 016	04.12.2023	-22 054	-0.01
DKK	172 190 000	CHF	22 125 804	04.12.2023	213 829	0.05
CHF	1 655 771	EUR	1 725 000	04.12.2023	-19 149	0.00
CHF	882 016	USD	1 000 000	04.12.2023	-12 466	0.00
CHF	284 182	AUD	490 000	04.12.2023	-1 670	0.00
CHF	341 538	EUR	355 000	04.12.2023	-4 726	0.00
USD	1 555 000	EUR	1 417 040	04.12.2023	-7 711	0.00
AUD	5 905 000	CHF	3 403 234	03.01.2024	7 721	0.00
DKK	178 180 000	CHF	22 791 365	03.01.2024	160 612	0.04
GBP	530 000	CHF	584 267	03.01.2024	2 852	0.00
EUR	44 870 000	CHF	42 760 213	03.01.2024	284 450	0.07
USD	48 490 000	CHF	42 272 030	03.01.2024	265 963	0.07
					2 712 278	0.68

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 08.06.23	EUR	105	0
EURO-BOBL FUTURE 08.06.23	EUR	185	0
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.23	EUR	650	0
EURO-BUND FUTURE 07.09.23	EUR	105	105
EURO-BOBL FUTURE 07.09.23	EUR	170	170
EURO-SCHATZ FUTURE 07.09.23	EUR	560	560
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.23	EUR	100	300
EURO-BUND FUTURE 07.12.23	EUR	20	105
EURO-BOBL FUTURE 07.12.23	EUR	0	96
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.23	USD	46	0
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.23	USD	51	0
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	50	50
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	50	50
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	0	50
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	0	30

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
GS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.47500% 21-09.07.26	CHF	7 000 000	7 000 000
GS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-09.07.26	CHF	7 000 000	7 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.78700% 23-28.08.26	CHF	25 000 000	25 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-28.08.26	CHF	25 000 000	25 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
ICE/MARKIT ITRX EUR CDI PAY 5.00000% 23-20.06.27	EUR	1 500 000
ICE/ITRX.XOVER S39 V2 CDI PAY 5.00000% 23-20.06.28	EUR	1 500 000
ICE/ITRX.XOVER.S37-V2 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27	EUR	1 500 000
ICE/IITRX EUR XOVER S39 V2 CDI REC 5.00000% 23-20.06.28	EUR	1 500 000
ICE/ITRX.XOVER S40 V1 CDI REC 5.00000% 23-20.12.28	EUR	1 500 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	1 929 434	EUR	1 985 000	05.07.2023
CHF	3 879 326	USD	4 340 000	05.07.2023
CHF	748 637	EUR	765 000	05.07.2023
CHF	540 218	GBP	475 000	05.07.2023
CHF	55 078 933	EUR	56 390 000	05.07.2023
CHF	5 517 416	AUD	9 245 000	05.07.2023
CHF	25 750 684	DKK	196 110 000	05.07.2023
EUR	57 340 000	CHF	55 925 365	02.08.2023
USD	55 085 000	CHF	49 490 733	02.08.2023
GBP	475 000	CHF	538 802	02.08.2023
AUD	9 245 000	CHF	5 506 138	02.08.2023
DKK	196 110 000	CHF	25 720 585	02.08.2023
AUD	9 245 000	CHF	5 374 120	05.09.2023
DKK	196 640 000	CHF	25 287 231	05.09.2023
USD	55 400 000	CHF	48 060 386	05.09.2023
EUR	57 940 000	CHF	55 518 572	05.09.2023
GBP	475 000	CHF	529 434	05.09.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	2 675 682	EUR	2 790 000	05.09.2023
CHF	506 501	AUD	885 000	05.09.2023
CHF	300 586	DKK	2 330 000	05.09.2023
CHF	1 443 127	USD	1 650 000	05.09.2023
CHF	1 324 126	EUR	1 380 000	05.09.2023
CHF	25 001 287	DKK	194 310 000	05.09.2023
CHF	4 770 550	AUD	8 360 000	05.09.2023
CHF	51 533 168	EUR	53 770 000	05.09.2023
CHF	531 145	GBP	475 000	05.09.2023
AUD	7 860 000	CHF	4 476 250	03.10.2023
DKK	193 810 000	CHF	24 902 084	03.10.2023
EUR	53 770 000	CHF	51 445 254	03.10.2023
GBP	475 000	CHF	529 601	03.10.2023
USD	53 895 000	CHF	47 369 124	03.10.2023
CHF	1 219 195	EUR	1 275 000	03.10.2023
CHF	2 207 913	DKK	17 200 000	03.10.2023
CHF	1 898 644	USD	2 160 000	03.10.2023
CHF	931 825	EUR	975 000	03.10.2023
CHF	783 290	USD	890 000	03.10.2023
CHF	1 094 212	EUR	1 145 000	03.10.2023
CHF	816 432	USD	915 000	03.10.2023
CHF	1 878 427	USD	2 075 000	03.10.2023
DKK	173 430 000	CHF	22 437 929	02.11.2023
AUD	7 860 000	CHF	4 635 561	02.11.2023
EUR	50 985 000	CHF	49 209 192	02.11.2023
GBP	475 000	CHF	528 982	02.11.2023
USD	48 145 000	CHF	43 710 557	02.11.2023
CHF	275 751	DKK	2 150 000	02.11.2023
CHF	966 878	AUD	1 670 000	02.11.2023
CHF	319 875	USD	355 000	02.11.2023
CHF	1 505 313	EUR	1 575 000	02.11.2023
CHF	584 757	EUR	620 000	02.11.2023
CHF	427 387	USD	480 000	02.11.2023
EUR	48 515 000	CHF	46 466 697	04.12.2023
GBP	475 000	CHF	520 427	04.12.2023
USD	47 475 000	CHF	42 691 656	04.12.2023
AUD	6 395 000	CHF	3 665 016	04.12.2023
DKK	172 190 000	CHF	22 125 804	04.12.2023
CHF	1 655 771	EUR	1 725 000	04.12.2023
CHF	882 016	USD	1 000 000	04.12.2023
CHF	284 182	AUD	490 000	04.12.2023
CHF	341 538	EUR	355 000	04.12.2023
USD	1 555 000	EUR	1 417 040	04.12.2023
AUD	5 905 000	CHF	3 403 234	03.01.2024
DKK	178 180 000	CHF	22 791 365	03.01.2024
GBP	530 000	CHF	584 267	03.01.2024
EUR	44 870 000	CHF	42 760 213	03.01.2024
USD	48 490 000	CHF	42 272 030	03.01.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,23% p.a.;
 - Klasse I-B: 0,04% p.a.;
 - Klasse I-X: 0,00% p.a.;
 - Klasse P: 0,29% p.a.;
 - Klasse Q: 0,27% p.a.;
- Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,55% p.a.;
 - Klasse I-B: 0,07% p.a.;
 - Klasse I-X: 0,00% p.a.;
 - Klasse P: 1,08% p.a.;
 - Klasse Q: 1,05% p.a.;berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der AMAS in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:


Klasse I-A1:	0,23%
Klasse I-B:	0,04%
Klasse I-X:	0,00%
Klasse P:	0,30%
Klasse Q:	0,27%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 2% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Bewertungs-Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF 0.58	GBP 1 = CHF 1.10
DKK 1 = CHF 0.13	USD 1 = CHF 0.87
EUR 1 = CHF 0.95	

 Follow us on LinkedIn

www.ubs.com

