



BEKB OBLIGATIONEN GLOBAL STAATSANLEIHEN

Jahresbericht per 31.08.2024

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

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

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 20.12.2024

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 20. Dezember 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

BEKB Obligationenfonds,

mit den Teilvermögen

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

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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



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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	28
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	28
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	28
7	Verwaltungskommission	29
8	Benchmark	29
9	TER	29
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	30
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	30
12	Fussnoten	30
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	31

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Berner Kantonalbank AG, Bundesplatz 8, 3011 Bern

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.09.2023	01.09.2022	01.09.2021	01.09.2020
	bis	31.08.2024	31.08.2023	31.08.2022	31.08.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		261'806'714.80	260'896'961.29	276'139'609.54	296'113'775.84
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		300'103.62	537'467.68	669'814.29	939'798.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'442.000	7'859.000	8'474.000	10'034.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		67.56	68.39	79.04	93.66
Ausschüttung je Anteil		0.80	1.10	1.65	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
Klasse A hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'660'907.21	1'666'802.93	1'945'353.48	2'284'009.12
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		22'585.783	22'476.683	24'382.783	25'048.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		73.54	74.16	79.78	91.19
Ausschüttung je Anteil		0.80	1.15	1.45	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse B	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		94'662.40	94'816.19	107'940.11	100'750.52
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000	1'271.000	1'011.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.48	74.60	84.93	99.65
Thesaurierung je Anteil		0.85	1.22	1.57	1.55
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %	0.80 %
Klasse B hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'174'718.51	1'281'189.59	1'392'814.63	1'866'746.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'650.000	16'000.000	16'358.000	19'370.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.19	80.07	85.15	96.37
Thesaurierung je Anteil		0.86	1.20	1.50	1.46
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse It	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		77.08	77.30	87.80	102.46
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1.000	1.000	1.000	1.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.08	77.30	87.80	102.46
Thesaurierung je Anteil		0.89	1.65	2.45	2.53
Total Expense Ratio (TER)		0.23 %	0.22 %	0.23 %	0.22 %
Klasse It hedged	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'427'750.90	5'499'606.44	5'815'524.49	5'786'196.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		65'055.000	66'380.000	66'380.000	58'680.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.43	82.85	87.61	98.61
Thesaurierung je Anteil		1.36	1.72	2.07	2.05
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %

Klasse Nt	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	68'741'345.96	71'339'480.42	80'786'090.22	90'787'253.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	856'257.729	891'465.961	890'922.741	857'492.070
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	80.28	80.02	90.68	105.88
Thesaurierung je Anteil	1.53	1.95	2.43	2.46
Total Expense Ratio (TER)	0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

Klasse Nt hedged	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	184'407'149.12	180'477'520.74	185'421'984.52	194'348'917.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	2'175'900.902	2'149'529.356	2'093'419.820	1'954'543.301
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	84.75	83.96	88.57	99.43
Thesaurierung je Anteil	1.59	1.95	2.33	2.32
Total Expense Ratio (TER)	0.03 %	0.03 %	0.03 %	0.03 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	0.41 %	-6.48 %	-16.36 %	-4.16 %
Klasse A hedged	0.73 %	0.52 %	-13.62 %	-3.48 %
Klasse B	0.42 %	-6.47 %	-16.36 %	-4.15 %
Klasse B hedged	0.68 %	0.48 %	-13.66 %	-3.53 %
Klasse It	0.47 %	-6.25 %	-15.69 %	-3.28 %
Klasse It hedged	1.44 %	1.25 %	-12.92 %	-2.94 %
Klasse Nt	1.19 %	-5.74 %	-15.72 %	-3.41 %
Klasse Nt hedged	1.77 %	1.60 %	-12.64 %	-2.64 %
Benchmark Hedge	2.03 %	2.16 %	-13.22%	-
Benchmark	1.31 %	-5.23 %	-16.20 %	-3.73 %
Tracking Error 33)	0.42 %	0.43 %	0.56 %	0.43 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse A	-0.90 %
Klasse A hedged	-1.30 %
Klasse B	-0.89 %
Klasse B hedged	-1.35 %
Klasse It	-0.84 %
Klasse It hedged	-0.59 %
Klasse Nt	-0.12 %
Klasse Nt hedged	-0.26 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	31.08.2023
Bankguthaben auf Sicht	3'034'538.25	2'012'493.34
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	255'616'243.05	258'556'158.21
Derivative Finanzinstrumente	1'554'007.23	-1'211'390.72
Sonstige Vermögenswerte	1'611'733.87	1'549'941.87
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	261'816'522.40	260'907'202.70
Andere Verbindlichkeiten	-9'807.60	-10'241.41
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	261'806'714.80	260'896'961.29

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Klasse A			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'859.000	8'474.000
Zurückgenommene Anteile		-3'417.000	-615.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'442.000	7'859.000
Klasse A hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'476.683	24'382.783
Ausgegebene Anteile		700.000	-
Zurückgenommene Anteile		-590.900	-1'906.100
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		22'585.783	22'476.683
Klasse B			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'271.000	1'271.000
Klasse B hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'000.000	16'358.000
Zurückgenommene Anteile		-1'350.000	-358.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		14'650.000	16'000.000
Klasse It			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1.000	1.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1.000	1.000
Klasse It hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		66'380.000	66'380.000
Zurückgenommene Anteile		-1'325.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		65'055.000	66'380.000
Klasse Nt			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		891'465.961	890'922.741
Ausgegebene Anteile		162'991.993	45'111.898
Zurückgenommene Anteile		-198'200.225	-44'568.678
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		856'257.729	891'465.961
Klasse Nt hedged			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'149'529.356	2'093'419.820
Ausgegebene Anteile		456'701.937	318'726.198
Zurückgenommene Anteile		-430'330.391	-262'616.662
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'175'900.902	2'149'529.356

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		260'896'961.29	276'139'609.54
Ausbezahlte Ausschüttung		-31'622.60	-49'315.46
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'110'745.39	-2'556'601.67
Saldo aus dem Anteilverkehr		-803'853.80	4'757'906.78
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		3'855'975.30	-17'394'637.90
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		261'806'714.80	260'896'961.29

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.09.2023 31.08.2024	01.09.2022 31.08.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		23'862.49	18'511.45
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-983.91	-5'449.57
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'866'574.45	6'212'810.59
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		606'325.45	316'875.82
Total Ertrag		5'495'778.48	6'542'748.29
Aufwand			
Passivzinsen		-597.52	-1'659.35
Reglementarische Vergütungen		-115'951.64	-125'387.86
Sonstige Aufwendungen		-43.05	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-474'564.26	-288'727.13
Total Aufwand		-591'156.47	-415'774.34
Nettoertrag / Verlust		4'904'622.01	6'126'973.95
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-24'269'164.18	-26'902'824.84
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		102'986.24	70'285.13
Realisierter Erfolg		-19'261'555.93	-20'705'565.76
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		23'117'531.23	3'310'927.86
Gesamterfolg		3'855'975.30	-17'394'637.90

Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	3'345.24	8'858.46
Vortrag des Vorjahres	216.11	2.55
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'561.35	8'861.01
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	3'553.60	8'644.90
Vortrag auf neue Rechnung	7.75	216.11
Total	3'561.35	8'861.01
Klasse A hedged	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	18'022.26	25'154.07
Vortrag des Vorjahres	138.41	832.53
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	18'160.67	25'986.60
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	18'068.63	25'848.19
Vortrag auf neue Rechnung	92.04	138.41
Total	18'160.67	25'986.60
Klasse B	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	1'082.10	1'555.15
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'082.10	1'555.15
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	378.74	544.30
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	703.37	1'010.85
Total	1'082.10	1'555.15
Klasse B hedged	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	12'716.04	19'314.93
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	12'716.04	19'314.93
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'450.61	6'760.23
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'265.43	12'554.70
Total	12'716.04	19'314.93
Klasse It	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	0.89	1.65
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.89	1.65
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.31	0.58
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.58	1.07
Total	0.89	1.65
Klasse It hedged	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	88'949.42	114'516.86
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	88'949.42	114'516.86
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	31'132.30	40'080.90
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	57'817.12	74'435.96
Total	88'949.42	114'516.86
Klasse Nt	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	1'310'378.28	1'746'544.49
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'310'378.28	1'746'544.49
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	458'632.40	611'290.57
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	851'745.88	1'135'253.92
Total	1'310'378.28	1'746'544.49
Klasse Nt hedged	31.08.2024	31.08.2023
Nettoertrag	3'470'127.78	4'211'028.34
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'470'127.78	4'211'028.34
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'214'544.72	1'473'859.92
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'255'583.06	2'737'168.42
Total	3'470'127.78	4'211'028.34

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							255'616'243.05	97.63	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							255'616'243.05	97.63	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	0	1'500	0	1'500 AUD	93.94%	811'155.38	0.31	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	2'800	830	2'550	1'080 AUD	81.49%	506'645.49	0.19	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	500	1'200	0	1'700 AUD	57.34%	561'115.70	0.21	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	2'600	0	2'600 AUD	82.33%	1'232'214.95	0.47	a)
AU0000300535	4.7500 % ACGB 4 3/4 06/21/54 169	0	600	0	600 AUD	103.98%	359'154.53	0.14	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	2'200	100	750	1'550 AUD	104.26%	930'287.53	0.36	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	500	0	300	200 AUD	100.90%	116'174.33	0.04	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	800	100	0	900 AUD	88.99%	461'072.89	0.18	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	3'000	0	2'300	700 AUD	89.50%	360'667.40	0.14	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	1'000	810	600	1'210 AUD	79.30%	552'341.00	0.21	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	1'180	80	1'260	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	2'100	1'500	1'440	2'160 AUD	98.54%	1'225'299.96	0.47	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	500	1'820	880	1'440 AUD	99.41%	824'053.81	0.31	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	770	290	0	1'060 AUD	96.67%	589'905.82	0.23	a)
AU							8'530'088.79	3.26	
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	850	1'520	2'370	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	150	0	70	80 CAD	90.84%	45'749.26	0.02	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	2'830	100	2'830 CAD	98.85%	1'761'155.07	0.67	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	230	0	0	230 CAD	77.68%	112'477.37	0.04	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	50	0	0	50 CAD	72.10%	22'695.84	0.01	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	2'000	0	400	1'600 CAD	92.64%	933'105.51	0.36	a)
CA135087VW17	8.0000 % CAN 8 06/01/27 VW17	190	0	190	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	100	0	0	100 CAD	112.32%	70'711.41	0.03	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	500	50	0	550 CAD	119.85%	414'984.75	0.16	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	500	80	0	580 CAD	118.89%	434'111.40	0.17	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	1'300	80	200	1'180 CAD	109.95%	816'774.28	0.31	a)
CA							4'611'764.89	1.76	
CND100010K57	3.6100 % CGB 3.61 06/07/25 INBK	25'000	0	3'300	21'700 CNY	101.82%	2'645'292.46	1.01	a)
CND10001Q6Q0	4.0800 % CGB 4.08 10/22/48 INBK	28'000	0	0	28'000 CNY	131.51%	4'408'362.64	1.68	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 INBK	30'000	0	0	30'000 CNY	106.07%	3'809'584.66	1.46	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	6'500	0	3'000	3'500 CNY	119.46%	500'570.52	0.19	a)
CND100031J20	1.9900 % CGB 1.99 04/09/25 INBK	15'000	0	3'000	12'000 CNY	100.27%	1'440'552.40	0.55	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	34'200	0	4'400	29'800 CNY	103.71%	3'699'919.96	1.41	a)
CND100036VL4	3.7300 % CGB 3.73 05/25/70 INBK	8'900	0	0	8'900 CNY	137.51%	1'465'180.92	0.56	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	8'000	0	0	8'000 CNY	104.41%	999'990.53	0.38	a)
CND10004GNL8	2.6900 % CGB 2.69 08/12/26 INBK	10'000	0	0	10'000 CNY	102.11%	1'222'452.75	0.47	a)
CND100058NN1	2.1800 % CGB 2.18 06/25/24 INBK	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10005JJ69	2.6900 % CGB 2.69 08/15/32 INBK	4'000	0	0	4'000 CNY	104.10%	498'501.17	0.19	a)
CND10005L4G7	2.6000 % CGB 2.6 09/01/32 INBK	4'000	2'900	0	6'900 CNY	103.47%	854'726.85	0.33	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	4'000	3'000	3'000	4'000 CNY	105.97%	507'484.90	0.19	a)
CND100074JJ4	2.3900 % CGB 2.39 11/15/26 INBK	0	3'500	2'900	600 CNY	101.58%	72'967.89	0.03	a)
CND10007LB61	2.3500 % CGB 2.35 02/25/34 INBK	0	9'000	0	9'000 CNY	101.51%	1'093'699.54	0.42	a)
CND10007LB79	2.0400 % CGB 2.04 02/25/27 INBK	0	3'500	0	3'500 CNY	100.91%	422'830.26	0.16	a)
CND10007NT69	2.6500 % CGB 2.65 03/25/2074 INBK	0	1'000	0	1'000 CNY	107.97%	129'263.21	0.05	a)
CND10007NT77	2.2800 % CGB 2.28 03/25/31 INBK	0	4'100	0	4'100 CNY	101.30%	497'215.03	0.19	a)
CND10007XGR7	1.8500 % CGB 1.85 05/15/27 INBK	0	3'000	0	3'000 CNY	100.49%	360'917.47	0.14	a)
CN							24'629'513.16	9.41	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	0	700	550	150 EUR	99.21%	139'764.35	0.05	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	800	1'200	1'350	650 EUR	85.41%	521'354.60	0.20	a)
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	5'100	10'900	16'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104891	0.4000 % BKO 0.4 09/13/24	0	3'290	790	2'500 EUR	99.91%	2'345'840.94	0.90	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	500	0	0	500 EUR	116.87%	548'784.92	0.21	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	400	0	100	300 EUR	121.61%	342'625.71	0.13	a)
DE							3'898'370.52	1.49	
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	3'000	0	2'500	500 EUR	101.44%	476'348.02	0.18	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	2'200	350	0	2'550 EUR	109.92%	2'632'409.53	1.01	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	2'400	3'000	3'500	1'900 EUR	99.89%	1'782'393.02	0.68	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	0	100	0	100 EUR	95.96%	90'122.10	0.03	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	1'300	300	1'150	450 EUR	89.30%	377'403.04	0.14	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	300	700	0	1'000 EUR	92.70%	870'632.81	0.33	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	0	1'300	0	1'300 EUR	97.37%	1'188'777.61	0.45	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	0	100	0	100 EUR	88.67%	83'276.61	0.03	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	0	450	300	150 EUR	55.99%	78'879.03	0.03	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	0	800	0	800 EUR	91.66%	688'624.87	0.26	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	2'500	1'020	1'900	1'620 EUR	71.97%	1'095'017.79	0.42	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	1'100	1'590	950	1'740 EUR	50.29%	821'720.75	0.31	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	0	2'480	0	2'480 EUR	74.30%	1'730'475.11	0.66	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	0	5'750	1'400	4'350 EUR	94.02%	3'841'138.04	1.47	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	1'600	1'300	500	2'400 EUR	85.41%	1'925'136.83	0.74	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	2'300	800	2'050	1'050 EUR	68.79%	678'355.70	0.26	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	300	100	0	400 EUR	97.47%	366'153.39	0.14	a)
ES							18'726'864.25	7.15	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29 OAT	3'100	1'000	340	3'760 EUR	112.17%	3'961'107.28	1.51	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55 OAT	400	0	300	100 EUR	108.81%	102'193.04	0.04	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45 OAT	2'000	0	0	2'000 EUR	98.13%	1'843'257.67	0.70	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36 OAT	0	1'170	0	1'170 EUR	82.09%	902'023.73	0.34	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26 OAT	5'000	2'300	520	6'780 EUR	95.00%	6'049'150.98	2.31	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 OAT	2'500	0	1'300	1'200 EUR	83.03%	935'757.46	0.36	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	500	1'200	500	1'200 EUR	66.30%	747'134.13	0.29	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30 OAT	0	2'690	0	2'690 EUR	84.80%	2'142'372.22	0.82	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44 OAT	0	400	0	400 EUR	59.36%	223'000.11	0.09	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53 OAT	0	2'000	0	2'000 EUR	51.28%	963'158.20	0.37	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32 OAT	3'000	500	0	3'500 EUR	93.93%	3'087'415.28	1.18	a)
FR							20'956'570.10	8.00	
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	900	2'400	1'180	2'120 GBP	102.74%	2'428'614.17	0.93	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	1'050	370	220	1'200 GBP	100.23%	1'341'181.48	0.51	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'300	100	800	600 GBP	105.64%	706'786.09	0.27	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	1'000	0	300	700 GBP	101.22%	790'059.92	0.30	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	2'190	0	1'200	990 GBP	104.05%	1'148'611.53	0.44	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	1'800	650	150	2'300 GBP	84.73%	2'172'996.51	0.83	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	900	900	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	2'100	300	1'700	700 GBP	59.96%	468'027.26	0.18	a)
GB00BHFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	0	1'050	340	710 GBP	99.95%	791'339.36	0.30	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	0	240	0	240 GBP	86.81%	232'327.30	0.09	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	1'800	520	850	1'470 GBP	98.44%	1'613'557.16	0.62	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	1'270	0	1'270 GBP	66.85%	946'679.29	0.36	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	0	820	820	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	3'000	200	100	3'100 GBP	64.14%	2'217'183.61	0.85	a)
GB							14'857'363.68	5.67	
XS2309433899	1.7500 % CROATI 1 3/4 03/04/41	400	0	0	400 EUR	78.97%	296'641.01	0.11	a)
HR							296'641.01	0.11	
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	2'000	700	0	2'700 EUR	88.71%	2'249'533.57	0.86	a)
IE							2'249'533.57	0.86	
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	500	0	0	500 EUR	111.32%	522'742.20	0.20	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	2'000	1'700	3'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	4'000	1'500	0	5'500 EUR	90.96%	4'698'500.14	1.79	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	500	7'800	5'600	2'700 EUR	96.75%	2'453'278.22	0.94	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	500	400	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	4'600	1'700	6'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	0	500	200	300 EUR	95.80%	269'918.33	0.10	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT							7'944'438.89	3.03	
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	0	390'000	0	390'000 JPY	99.39%	2'258'717.43	0.86	a)
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	1'720'000	0	1'720'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	300'000	450'000	0	750'000 JPY	98.81%	4'318'077.39	1.65	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	500'000	0	200'000	300'000 JPY	97.77%	1'709'207.83	0.65	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	50'000	0	50'000 JPY	99.96%	291'239.87	0.11	a)
JP1103741Q44	0.8000 % JGB 0.8 03/20/34 374	0	50'000	0	50'000 JPY	99.38%	289'544.19	0.11	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	0	2'220'000	666'000	1'554'000 JPY	100.10%	9'064'231.49	3.46	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	1'290'000	92'000	1'200'000	182'000 JPY	102.21%	1'083'953.78	0.41	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	1'180'000	50'000	828'000	402'000 JPY	104.38%	2'445'153.13	0.93	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	1'100'000	350'000	490'000	960'000 JPY	109.60%	6'130'786.21	2.34	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	100'000	580'000	0	680'000 JPY	104.49%	4'140'398.95	1.58	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	80'000	0	0	80'000 JPY	92.83%	432'736.86	0.17	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	50'000	0	0	50'000 JPY	84.46%	246'085.91	0.09	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	0	50'000	0	50'000 JPY	89.06%	259'479.43	0.10	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	0	50'000	0	50'000 JPY	90.85%	264'703.40	0.10	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	380'000	0	0	380'000 JPY	114.08%	2'525'947.44	0.96	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	630'000	0	0	630'000 JPY	107.21%	3'935'773.81	1.50	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	440'000	0	45'000	395'000 JPY	99.25%	2'284'452.97	0.87	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	0	50'000	0	50'000 JPY	89.93%	262'025.86	0.10	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	0	40'000	0	40'000 JPY	81.03%	188'869.32	0.07	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	625'000	0	0	625'000 JPY	103.64%	3'774'448.17	1.44	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	200'000	0	0	200'000 JPY	96.22%	1'121'303.08	0.43	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	40'000	0	0	40'000 JPY	60.51%	141'043.06	0.05	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	65'000	0	0	65'000 JPY	68.30%	258'696.56	0.10	a)
JP1400171Q50	2.2000 % JGB 2.2 03/20/64 17	0	40'000	0	40'000 JPY	96.83%	225'698.74	0.09	a)
JP							47'652'574.88	18.20	
XS1310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2168038417	0.2500 % LITHUN 0 1/4 05/06/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.73%	275'336.31	0.11	a)
LT							275'336.31	0.11	
XS1409726731	1.3750 % LATVIA 1 3/8 05/16/36 GMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2361416915	0.0000 % LATVIA 0 01/24/29 GMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LV							0.00	0.00	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	400	200	200	400 NZD	98.78%	209'744.76	0.08	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	530	0	300	230 NZD	101.56%	123'996.16	0.05	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	200	0	0	200 NZD	96.32%	102'254.31	0.04	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	280	0	0	280 NZD	83.35%	123'884.26	0.05	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	600	0	600	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	260	0	0	260 NZD	99.76%	137'688.03	0.05	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	300	150	0	450 NZD	66.50%	158'839.75	0.06	a)
NZ							856'407.27	0.33	
PTOTE5OE0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37 31Y	350	0	0	350 EUR	110.49%	363'197.87	0.14	a)
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45 30Y	320	0	0	320 EUR	110.11%	330'921.61	0.13	a)
PTOTECOEO0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52 31Y	400	0	0	400 EUR	57.31%	215'295.29	0.08	a)
PTOTENOEO0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35 15Y	350	0	0	350 EUR	80.49%	264'583.47	0.10	a)
PTOTEZOEO0014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38 15Y	320	0	0	320 EUR	103.47%	310'963.47	0.12	a)
PT							1'484'961.71	0.57	
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	600	0	0	600 EUR	86.28%	486'164.05	0.19	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	600	0	0	600 EUR	81.55%	459'522.14	0.18	a)
SI							945'686.19	0.36	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SK4000017059	1.0000 % SLOVGB 1 10/09/30 237	0	1'000	0	1'000 EUR	89.06%	836'400.66	0.32	a)
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	1'000	0	0	1'000 EUR	69.45%	652'260.85	0.25	a)
SK4000021986	4.0000 % SLOVGB 4 10/19/32 244	0	3'000	0	3'000 EUR	105.06%	2'960'136.51	1.13	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	900	2'300	0	3'200 EUR	89.13%	2'678'465.61	1.02	a)
SK							7'127'263.63	2.72	
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	140	1'200	0	1'340 USD	110.33%	1'254'345.83	0.48	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	140	900	0	1'040 USD	104.00%	917'683.52	0.35	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	4'000	2'100	4'200	1'900 USD	80.33%	1'294'933.56	0.49	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	1'000	700	850	850 USD	79.86%	575'931.84	0.22	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	5'700	500	4'350	1'850 USD	70.27%	1'102'912.08	0.42	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	500	300	50	750 USD	64.02%	407'355.43	0.16	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	8'400	900	2'000	7'300 USD	52.53%	3'253'620.15	1.24	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	0	4'620	1'300	3'320 USD	64.11%	1'805'867.49	0.69	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	2'500	1'500	1'000	3'000 USD	64.67%	1'646'125.57	0.63	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	5'980	4'200	5'700	4'480 USD	66.39%	2'523'544.84	0.96	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	5'500	2'800	5'000	3'300 USD	69.48%	1'945'482.60	0.74	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	5'200	2'100	2'000	5'300 USD	61.33%	2'757'793.93	1.05	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	500	300	50	750 USD	89.69%	570'715.20	0.22	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	0	465	465	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	6'100	14'000	9'410	10'690 USD	93.59%	8'488'179.53	3.24	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	19'500	0	19'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	0	3'500	0	3'500 USD	91.21%	2'708'577.21	1.03	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	9'900	1'600	4'100	7'400 USD	83.34%	5'232'762.35	2.00	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	11'800	6'000	5'000	12'800 USD	96.00%	10'426'177.80	3.98	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	0	4'000	0	4'000 USD	95.36%	3'236'173.91	1.24	a)
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	0	7'000	800	6'200 USD	94.75%	4'984'219.53	1.90	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	5'340	12'685	18'025	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	0	14'000	7'000	7'000 USD	93.91%	5'577'465.03	2.13	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	23'100	2'650	5'770	19'980 USD	90.02%	15'260'801.11	5.83	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	0	16'500	4'900	11'600 USD	87.34%	8'596'389.34	3.28	a)
US91282CE561	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	0	7'400	0	7'400 USD	95.66%	6'005'806.35	2.29	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	0	12'980	12'980	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US							90'572'864.20	34.59	
Derivative Finanzinstrumente							1'554'007.23	0.59	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CAD/CHF	Verfall 07.09.2023	32'491	49'500		CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023	54'300	93'200		CHF/AUD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023	367'888	60'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023	8'492	15'800		CHF/NZD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023	97'794	88'000		CHF/GBP	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 07.09.2023	155'597	1'283'000		CHF/CNY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	539'739	625'000		CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023	397'720	417'000		CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	13'086	15'000		CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023	4'755	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023	700'000	4'322		JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall 07.09.2023	45'000	5'506		CNY/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 07.09.2023	5'000	5'577		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.09.2023	10'000	8'818		USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 07.09.2023	6'980	8'000		CHF/USD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023	32'175	49'500		CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023	52'699	93'200		CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023	401'009	422'000		CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023	358'908	59'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 12.10.2023	565'205	638'000		CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023	92'323	83'000		CHF/GBP	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 12.10.2023	150'322	1'238'000		CHF/CNY	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 12.10.2023	8'226	15'800		CHF/NZD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	12'000	10'708		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023	7'000	6'711		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023	800'000	4'878		JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 12.10.2023	5'000	4'509		USD/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		6'000	5'780	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		1'000'000	6'116	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		4'000	2'693	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		6'000	3'513	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		26'000	3'215	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		12'000	10'978	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		900'000	5'559	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		5'000	4'861	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		20'000	2'526	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		3'000	3'361	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		4'000	3'900	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		6'000	5'528	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		544'898	603'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		8'605	15'800	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		346'009	56'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		88'630	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		383'394	400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		147'804	1'192'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		30'246	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		50'569	87'200	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		1'500'000	9'168	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		10'000	5'829	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		4'700	2'590	NZD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		7'629	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		8'975	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		5'704	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		7'208	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		7'240	1'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		3'315	27'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		7'000	6'318	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		1'319	11'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		12'000	6'926	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		4'479	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		5'856	11'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		340'061	56'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		88'060	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		561'411	619'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		397'406	414'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		152'284	1'230'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		29'739	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		37'480	65'200	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		4'000	3'660	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		500'000	3'049	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		4'000	2'342	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		8'928	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		11'470	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		8'786	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		9'589	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		5'474	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		2'281	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		2'411	20'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		6'000	3'485	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		9'000	7'998	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		5'268	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		5'883	1'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'700	14'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		549'775	635'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		5'937	11'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		344'727	58'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		93'196	85'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		401'235	424'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		153'677	1'264'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		29'073	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		34'028	59'200	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		8'628	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		7'540	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'933	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		500'000	3'003	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		28'000	3'437	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		17'000	14'826	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		5'000	4'733	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'016	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		4'380	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		7'538	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'165	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		4'193	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		5'601	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		3'521	30'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		12'505	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		10'659	1'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		9'253	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		6'373	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		1'871	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		2'550	4'500		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		2'321	20'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		714	1'400		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		8'000	7'465		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		3'000	3'258		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		500'000	2'999		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		8'000	6'846		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		8'442	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		15'000	8'590		AUD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		6'623	12'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		570'252	671'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		350'654	59'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		99'344	92'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		411'469	443'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		152'360	1'286'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		30'765	48'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		27'688	48'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		15'000	13'044		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		12'000	11'335		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		1'200'000	7'073		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		5'500	6'077		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		3'000	1'956		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		9'000	1'112		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		2'200	1'195		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		4'000	3'483		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		9'293	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		2'900'000	16'999		JPY/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		22'737	40'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		2'493	21'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		566'294	652'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		5'409	10'300		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		323'670	55'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		94'083	86'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		156'393	1'298'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		411'368	441'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		29'202	45'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		49'915	88'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		20'000	17'401		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		6'910	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		13'000	11'524		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		19'297	22'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		11'325	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		568'654	649'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		434'360	453'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		328'020	55'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		96'950	86'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		29'593	45'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		51'470	88'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.04.2024		5'566	10'300		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		158'216	1'298'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		5'000	4'824		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		720'000	4'309		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		7'850	9'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		3'025	25'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		7'633	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		12'000	10'642		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		6'000	5'430		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		9'000	8'780		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.04.2024		40'000	4'989		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		577'229	640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2024		5'602	10'300		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		98'685	86'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		325'161	54'480'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		438'077	447'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		159'909	1'283'000		CHF/CNY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		30'224	45'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		52'848	88'700	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		9'000	8'147	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		14'000	13'751	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		1'100'000	6'595	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		5'100	5'849	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		9'757	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		2'659	450'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		1'600	13'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		7'252	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		10'000	9'736	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		2'230	18'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		500'000	2'982	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		3'837	6'600	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		6'000	3'617	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		577'911	644'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 13.06.2024		5'437	10'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		309'709	53'620'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		93'338	83'400	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		421'213	432'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		161'631	1'281'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		29'731	45'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		53'699	89'700	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		2'976	24'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.06.2024		900'000	5'255	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		13'315	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		590'630	659'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		5'491	10'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		301'654	52'720'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		95'033	83'400	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		161'184	1'305'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		415'729	432'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		29'300	45'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		53'068	89'700	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		9'153	1'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		3'211	26'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		4'811	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		5'326	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		8'821	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		4'000	3'554	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		893	1'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		2'000	1'913	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		300'000	1'681	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		2'036	1'800	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		1'307	2'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		2'253	3'800	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		2'207	18'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		7'000	6'787	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		12'000	10'839	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		12'000	10'832	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		11'000	10'670	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		2'900'000	16'232	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.07.2024		3'000	1'978	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		5'000	5'722	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.07.2024		3'000	1'805	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.07.2024		32'000	3'955	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.07.2024		20'000	2'469	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		8'070	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		588'984	657'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		284'687	51'120'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 09.08.2024		5'452	10'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		94'193	81'900	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		409'930	422'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		159'484	1'295'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		29'903	45'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		55'353	91'500	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		7'072	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		7'000	6'237	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		5'271	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		5'725	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		3'436	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		2'068	17'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		7'035	7'500	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		13'739	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USD/CHF	Verfall 09.08.2024		18'669	22'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 09.08.2024		10'122	1'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 09.08.2024		3'248	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 09.08.2024		2'198	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 09.08.2024		2'983	25'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 09.08.2024		5'591	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.09.2024		591'191	686'000	CHF/USD		10'081.06	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 13.09.2024		5'185	10'000	CHF/NZD		-115.48	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 13.09.2024		315'099	53'620'000	CHF/JPY		2'534.52	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 13.09.2024		93'098	84'900	CHF/GBP		-1'430.97	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 13.09.2024		410'023	434'500	CHF/EUR		2'361.93	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 13.09.2024		163'425	1'357'000	CHF/CNY		981.10	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 13.09.2024		28'525	45'400	CHF/CAD		-21.30	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 13.09.2024		54'002	95'500	CHF/AUD		-906.60	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 13.09.2024		1'100'000	6'468	JPY/CHF		-56.08	0.00	b)
Klasse A hedged							13'428.18	0.01	
AUD/CHF	Verfall 07.09.2023		41'307	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.09.2023		116'910	964'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 07.09.2023		6'503	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		414'520	480'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2023		71'678	64'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.09.2023		24'615	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.09.2023		306'158	321'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.09.2023		281'416	46'050'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.09.2023		500'000	3'095	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 07.09.2023		15'000	1'855	CNY/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		8'714	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.09.2023		8'000	7'060	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		6'980	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 12.10.2023		274'761	45'550'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 12.10.2023		305'033	321'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 12.10.2023		115'230	949'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 12.10.2023		71'745	64'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 12.10.2023		40'089	70'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 12.10.2023		6'300	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 12.10.2023		24'375	37'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.10.2023		434'092	490'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		8'000	7'149	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023		1'300'000	7'941	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		5'000	4'509	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		7'000	6'739	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 12.10.2023		17'000	2'113	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 12.10.2023		4'000	2'352	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 12.10.2023		3'000	2'028	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 12.10.2023		2'000	2'244	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		8'000	7'329	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 12.10.2023		4'000	3'895	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.10.2023		500'000	3'102	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 12.10.2023		15'000	1'902	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 12.10.2023		5'000	4'606	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		419'291	464'000	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.11.2023		6'590	12'100	CHF/NZD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		266'512	43'750'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		69'243	62'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		297'131	310'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023		113'705	917'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023		22'934	34'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023		38'797	66'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.11.2023		1'200'000	7'340	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.11.2023		2'000	2'246	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 02.11.2023		3'500	1'936	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.11.2023		7'500	4'380	AUD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		6'273	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		6'303	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		7'615	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		6'028	1'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023		2'572	21'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023		1'073	9'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		7'000	6'318	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.11.2023		9'500	5'489	AUD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		4'479	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		431'715	476'000	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.12.2023		4'537	8'600	CHF/NZD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		262'117	43'550'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		66'596	60'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		305'254	318'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		117'246	947'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		22'549	34'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		28'685	49'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		4'000	3'660		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		400'000	2'445		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		3'000	1'764		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		7'136	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		8'816	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		7'665	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		6'435	1'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		5'474	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		1'703	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'679	14'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		4'000	2'334		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		5'000	4'457		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		4'109	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		3'502	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'329	11'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		423'370	489'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		4'600	8'600		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		264'880	44'950'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		71'816	65'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		308'497	326'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		118'176	972'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		22'044	34'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		26'383	45'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'896	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		6'594	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'192	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		9'000	7'863		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		11'000	1'369		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'153	6'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		4'380	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		5'646	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		4'299	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		3'349	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		4'663	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		2'811	24'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		9'162	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		6'468	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		8'877	1'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		4'772	4'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		2'188	3'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		2'092	3'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		1'733	15'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		554	1'100		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		7'000	6'536		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		6'000	5'142		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		400'000	2'405		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		3'000	3'258		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		6'747	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		12'000	6'878		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		443'624	522'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		5'139	9'700		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		76'667	71'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		272'304	46'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		118'476	1'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		319'516	344'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		24'104	38'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		21'377	37'600		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		12'000	10'441		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		9'000	8'509		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		900'000	5'312		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		4'000	4'428		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		2'700	1'763		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		7'000	872		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		1'700	930		NZD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		6'496	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		5'000	4'346		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		17'614	31'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		1'893	16'000		CHF/CNY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		2'300'000	13'488		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		438'617	505'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		251'255	42'850'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		4'201	8'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		319'020	342'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		72'874	67'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		121'572	1'009'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		22'656	35'300		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		38'604	68'600		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		15'000	13'058		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		6'910	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		11'000	9'756		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.03.2024		1'000'000	5'927		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.03.2024		3'000	3'388		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.03.2024		25'000	3'098		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		426'709	487'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		327'927	342'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		248'689	41'850'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		71'732	64'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		22'959	35'300		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		39'807	68'600		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.04.2024		4'323	8'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		119'942	984'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		5'000	4'824		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		780'000	4'665		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.04.2024		2'200	1'307		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		6'975	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		6'675	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		8'000	7'105		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		45'000	40'531		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		35'000	34'060		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		3'200'000	19'080		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.04.2024		6'000	6'852		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.04.2024		6'000	3'554		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.04.2024		100'000	12'427		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.04.2024		4'000	2'691		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		398'649	442'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2024		4'351	8'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		226'025	37'870'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		66'170	58'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		302'832	309'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		110'179	884'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		20'792	31'300		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		35'987	60'400		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		6'500	5'893		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		10'500	10'321		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		1'100'000	6'595		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		6'821	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		4'521	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		7'000	6'824		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		3'076	5'300		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		2'858	23'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		6'000	3'617		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		398'217	444'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 13.06.2024		3'806	7'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		212'437	36'990'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		66'357	57'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		291'047	298'500		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		111'893	884'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		20'679	31'300		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		36'011	61'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		2'100	17'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.06.2024		700'000	4'094		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		8'866	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		407'347	454'500		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		3'844	7'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		207'645	36'290'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		64'950	57'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		287'257	298'500		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		111'285	901'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		20'380	31'300		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		36'503	61'700		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		6'865	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		2'099	17'000		CHF/CNY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		2'886	3'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		4'439	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		6'175	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		3'000	2'666	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		1'000	956	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		893	1'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		170'000	953	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		2'262	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		719	1'100	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		1'719	2'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		1'716	14'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		8'000	7'226	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		5'000	4'848	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		1'100'000	6'157	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		2'000	2'289	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.07.2024		17'000	2'099	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		7'173	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		416'413	464'500	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 09.08.2024		3'816	7'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		201'709	36'220'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		66'489	57'800	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		289'476	298'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		112'686	915'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		21'340	32'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		39'080	64'600	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		4'420	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		5'000	4'455	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		3'514	4'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		3'817	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		1'718	300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		1'338	11'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		9'446	11'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		4'690	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		13'577	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		7'145	1'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		2'165	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		1'648	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		2'387	20'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		4'659	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		417'540	484'500	CHF/USD		7'119.93	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 13.09.2024		3'629	7'000	CHF/NZD		-80.83	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		222'472	37'850'000	CHF/JPY		1'834.51	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		65'574	59'800	CHF/GBP		-1'007.92	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		289'706	307'000	CHF/EUR		1'668.84	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 13.09.2024		115'373	958'000	CHF/CNY		692.63	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		20'357	32'400	CHF/CAD		-15.19	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		38'225	67'600	CHF/AUD		-641.75	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 13.09.2024		760'000	4'469	JPY/CHF		-38.75	0.00	b)
Klasse B hedged							9'531.47	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.09.2023		501'355	4'134'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		105'285	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		293'936	264'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		1'204'498	197'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		1'787'617	2'070'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		1'311'426	1'375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		27'142	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		172'395	295'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		1'400'000	8'613	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		26'201	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		11'064	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.09.2023		50'000	6'114	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		25'000	22'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		21'875	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		305'334	274'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		104'259	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.10.2023		26'293	50'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		1'306'605	1'375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.10.2023		495'892	4'084'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		1'860'394	2'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		167'312	295'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		1'180'476	195'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		30'000	26'725	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		5'000'000	30'459	JPY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		25'000	23'990		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		20'000	17'946		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		5'000	5'564		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		10'000	6'689		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		8'000	4'673		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		80'000	9'831		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		35'000	31'962		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		15'000	14'523		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		2'500'000	15'389		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		60'000	7'518		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		5'000	5'582		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		45'000	41'232		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		35'000	33'894		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		4'000'000	24'584		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		7'000	4'780		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		7'000	7'848		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		60'000	7'564		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		13'000	7'665		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 12.10.2023		4'000	2'212		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		20'000	18'425		USD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		25'324	46'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'762'108	1'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		1'122'093	184'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		285'279	257'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'246'032	1'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		481'604	3'884'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		95'326	143'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		159'419	274'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		5'100'000	31'099		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		25'000	14'528		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		10'300	5'640		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		31'486	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		27'112	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		38'196	40'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		24'204	4'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		8'270	67'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		25'000	22'486		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		4'261	35'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		39'000	22'442		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		13'496	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'818'465	2'005'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		1'102'037	183'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		19'099	36'200		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		283'444	257'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'286'290	1'340'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		493'499	3'986'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		93'726	143'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		121'235	210'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		10'000	9'104		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		1'400'000	8'484		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		10'000	5'809		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		26'844	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		29'358	5'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		39'777	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		33'635	35'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		19'786	18'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		5'746	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		7'904	65'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'856	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		25'000	22'163		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		18'000	10'396		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		13'215	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		17'708	3'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		5'901	48'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'783'521	2'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		19'362	36'200		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		1'117'858	189'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		302'066	275'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'301'175	1'375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		498'356	4'099'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		95'461	149'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		110'879	192'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		25'944	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		23'628	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		26'082	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		40'000	34'843	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		55'000	6'723	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		17'245	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		18'712	17'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		21'615	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		22'674	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		23'433	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		16'863	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		11'808	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		41'752	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		27'819	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		36'786	6'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		6'941	11'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		20'245	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		9'145	16'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		7'609	65'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		2'520	4'800	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		30'000	25'590	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		30'000	27'912	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		1'800'000	10'719	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		8'000	8'639	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		29'621	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		45'000	25'710	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		1'869'679	2'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		21'722	41'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		1'147'756	194'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		327'726	303'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		1'345'867	1'449'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		498'665	4'209'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		101'745	160'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		93'183	163'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		50'000	43'411	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		40'000	37'714	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		3'700'000	21'745	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		20'000	22'021	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		12'000	7'734	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		30'000	3'638	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		7'500	4'003	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		5'000	2'875	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		15'000	12'978	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		35'398	38'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		9'700'000	56'788	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		73'962	130'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		8'741	73'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		1'854'352	2'135'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		17'592	33'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		1'059'551	180'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		308'354	283'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		512'315	4'252'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		1'349'772	1'447'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		162'576	288'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		95'245	148'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		70'000	60'829	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		30'334	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		47'000	41'585	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.03.2024		4'000'000	23'619	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.03.2024		15'000	14'409	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.03.2024		13'000	14'580	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.03.2024		100'000	12'303	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		1'798'839	2'053'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		1'373'075	1'432'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		1'050'022	176'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		303'180	270'500	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		96'519	148'400	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		167'640	288'900	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.04.2024		18'103	33'500	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		506'096	4'152'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		8'000	7'701	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		3'600'000	21'423	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.04.2024		9'000	5'253	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		30'616	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		23'918	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		6'080	50'000	CHF/CNY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		33'000	29'214		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		20'000	18'030		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		25'000	24'337		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.04.2024		130'000	16'146		CNY/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2024		18'221	33'500		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		1'835'407	2'035'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		1'033'137	173'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		308'604	270'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		1'395'574	1'424'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		98'578	148'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		507'522	4'072'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		166'766	279'900		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		30'000	27'088		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		50'000	49'032		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		3'400'000	20'323		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2024		5'000	3'351		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		12'000	13'721		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		8'000	4'797		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.05.2024		43'000	5'390		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		34'224	35'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		8'934	1'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		11'380	91'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		22'726	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		33'000	32'059		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		1'300'000	7'704		JPY/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		18'135	31'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		7'252	58'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		20'000	11'988		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		1'847'782	2'049'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 13.06.2024		17'398	32'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		995'724	170'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		298'393	264'300		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		1'341'643	1'376'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		511'515	4'074'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		94'741	143'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		167'429	285'400		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		10'242	82'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.06.2024		2'800'000	16'287		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		44'452	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		1'881'233	2'099'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		17'571	32'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		960'121	167'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		1'324'174	1'376'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		301'165	264'300		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		513'320	4'156'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		93'369	143'400		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		168'847	285'400		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		9'879	80'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		29'176	5'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		14'432	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		19'530	22'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		11'399	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		11'000	10'503		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		29'110	33'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		15'000	13'329		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		4'463	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		6'000	5'738		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		660'000	3'699		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		8'484	7'500		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		4'248	6'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		7'114	12'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		8'091	66'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		382	700		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		35'000	31'614		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		20'000	19'391		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		5'000'000	27'986		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		10'000	11'443		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		8'000	7'760		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.07.2024		75'000	9'260		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		31'383	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		1'922'042	2'144'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 09.08.2024		17'827	32'700		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		931'360	167'240'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		307'192	267'100		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		1'335'671	1'375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		520'572	4'227'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		97'633	148'200	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		179'914	297'400	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		20'331	23'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		22'000	19'601	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		20'991	22'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		17'570	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		8'589	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		2'304	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		6'081	50'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		42'936	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		21'575	23'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		63'643	75'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		32'747	5'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		12'992	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		6'593	12'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		10'739	90'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		20'499	22'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		1'927'835	2'237'000	CHF/USD		32'873.66	0.01	b)
	NZD/CHF Verfall 13.09.2024		16'954	32'700	CHF/NZD		-377.61	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		306'051	279'100	CHF/GBP		-4'704.19	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		1'027'539	174'855'000	CHF/JPY		8'265.10	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		1'338'120	1'418'000	CHF/EUR		7'708.20	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 13.09.2024		533'148	4'427'000	CHF/CNY		3'200.70	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		95'610	152'200	CHF/CAD		-89.66	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		177'215	313'400	CHF/AUD		-2'975.19	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 13.09.2024		3'550'000	20'875	JPY/CHF		-181.01	0.00	b)
Klasse It hedged							43'720.00	0.02	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		3'439'484	5'240'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		58'507'748	67'750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		9'668'223	8'700'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.09.2023		39'862'705	6'523'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		43'014'756	45'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.09.2023		16'441'387	135'570'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.09.2023		897'577	1'670'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		5'791'183	9'940'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.09.2023		100'000'000	613'198	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.09.2023		332'754	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		1'136'450	1'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.09.2023		1'500'000	182'561	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		900'000	791'089	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		700'812	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.10.2023		3'405'958	5'240'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.10.2023		10'010'943	9'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		42'856'636	45'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.10.2023		869'480	1'670'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		61'082'943	68'950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.10.2023		5'620'424	9'940'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.10.2023		16'279'182	134'070'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.10.2023		38'743'986	6'423'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		1'000'000	890'021	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		300'000	268'793	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		600'000	575'154	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		130'000'000	791'300	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2023		714'002	800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.10.2023		478'755	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.10.2023		250'000	166'503	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		1'000'000	122'543	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.10.2023		400'000	232'220	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		1'200'000	1'095'011	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.10.2023		20'000'000	122'900	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		450'000	434'888	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.10.2023		200'000	222'108	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.10.2023		1'500'000	187'232	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		300'000	274'735	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.10.2023		400'000	387'091	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2023		500'000	460'636	USD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		909'479	1'670'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		60'047'210	66'450'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		38'213'297	6'273'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		9'749'353	8'800'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		16'314'285	131'570'000	CHF/CNY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		42'317'157	44'150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'317'137	4'990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		5'532'418	9'540'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		170'000'000	1'035'834		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		1'000'000	580'048		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		440'000	239'682		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'125'344	1'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		574'298	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		904'554	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		859'909	900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		787'436	130'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		371'601	3'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		500'000	449'201		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		220'646	1'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		500'000	450'968		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		700'000	670'482		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		60'000'000	363'222		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		1'400'000	804'703		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		1'600'000	197'008		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		61'401'531	67'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		648'933	1'230'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		37'153'867	6'173'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		9'686'644	8'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		43'148'314	44'950'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		16'685'604	134'770'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		4'104'393	7'140'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'261'444	4'990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		500'000	453'793		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		50'000'000	301'995		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		400'000	231'214		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		806'063	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'149'747	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'154'011	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		822'682	140'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		495'292	450'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		134'241	1'100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		196'352	340'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		700'000	619'840		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		600'000	345'602		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		529'693	600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		591'135	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		210'004	1'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		59'999'039	69'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		37'495'696	6'363'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		657'873	1'230'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		10'141'950	9'250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		43'672'160	46'150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		16'725'761	137'570'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		3'188'425	4'990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		3'724'698	6'480'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		735'774	850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		756'895	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		870'235	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		1'500'000	1'305'758		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.01.2024		2'500'000	304'298		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		210'000	197'567		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		20'000'000	118'932		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		474'979	550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		551'113	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		803'923	850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		692'514	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		591'122	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		750'678	800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		449'768	3'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'420'302	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'020'928	1'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		1'294'259	218'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		725'504	680'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		247'120	390'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		292'392	510'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		258'518	2'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.01.2024		76'472	144'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		800'000	681'749		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.01.2024		60'000'000	356'388		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		850'000	790'138	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.01.2024		250'000	269'071	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		931'700	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.01.2024		1'500'000	856'166	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		62'634'240	73'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.02.2024		727'956	1'374'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		38'441'843	6'501'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		10'992'578	10'180'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		45'178'048	48'640'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.02.2024		3'412'647	5'380'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		3'121'257	5'490'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		16'713'409	141'070'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		1'400'000	1'214'892	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		1'200'000	1'130'734	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		105'000'000	616'367	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		660'000	725'837	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		370'000	237'597	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		580'000	69'787	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.02.2024		245'000	129'800	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.02.2024		145'000	82'543	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2024		5'700'000	4'921'038	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.02.2024		2'300'000	2'144'808	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.02.2024		760'000'000	4'447'946	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.02.2024		2'105'511	3'700'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.02.2024		680'000	744'340	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.02.2024		7'900'000	949'525	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.02.2024		375'000	240'687	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.02.2024		931'296	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.02.2024		704'261	120'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2024		1'414'401	1'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.02.2024		218'325	200'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.02.2024		215'167	1'800'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		59'278'469	68'250'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.03.2024		592'891	1'129'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.03.2024		33'750'824	5'756'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.03.2024		2'974'789	4'635'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.03.2024		9'832'537	9'040'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.03.2024		16'192'382	134'390'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.03.2024		43'039'715	46'140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.03.2024		5'089'992	9'045'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		2'000'000	1'737'464	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.03.2024		954'099	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.03.2024		1'250'000	1'105'400	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.03.2024		40'000'000	235'936	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.03.2024		250'000	279'865	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.03.2024		67'000'000	395'606	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		57'916'820	66'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		44'241'385	46'140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.04.2024		9'851'937	8'790'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.04.2024		33'568'618	5'649'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.04.2024		3'014'604	4'635'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.04.2024		5'248'542	9'045'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.04.2024		610'103	1'129'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		16'381'066	134'390'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		500'000	479'528	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		103'000'000	612'199	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.04.2024		1'900'000	231'682	CNY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.04.2024		766'169	800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.04.2024		744'112	850'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.04.2024		277'326	2'270'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		1'300'000	1'138'670	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		680'000	650'985	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.04.2024		4'600'000	561'177	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		1'200'000	1'061'459	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		700'000	674'561	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		35'000'000	208'265	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.04.2024		230'000	259'070	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.04.2024		450'000	405'086	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.04.2024		350'000	340'361	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.04.2024		45'000'000	267'943	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.04.2024		220'000	129'231	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.04.2024		2'000'000	247'984	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		57'722'880	64'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 10.05.2024		614'069	1'129'000	CHF/NZD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		32'623'493	5'466'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		9'765'804	8'560'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		43'817'499	44'710'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		15'973'478	128'160'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.05.2024		3'078'891	4'635'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		5'257'997	8'825'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2024		400'000	360'848		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		90'000'000	537'280		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		1'100'000	1'078'274		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 10.05.2024		365'000	416'509		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.05.2024		515'000	64'228		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		205'000	122'177		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 10.05.2024		83'000	45'176		NZD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.05.2024		1'027'407	1'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 10.05.2024		328'614	55'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		376'083	3'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		728'057	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2024		900'000	873'698		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 10.05.2024		39'000'000	230'263		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 10.05.2024		147'253	130'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.05.2024		585'855	1'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.05.2024		238'503	1'900'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2024		904'362	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 10.05.2024		500'000	299'009		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		61'534'812	68'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 13.06.2024		576'066	1'063'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.06.2024		33'341'718	5'672'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.06.2024		9'967'271	8'790'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		44'598'518	45'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		16'963'944	135'445'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		3'147'039	4'765'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		5'680'021	9'490'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.06.2024		52'000'000	301'972		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		463'414	3'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		627'033	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.06.2024		98'573	150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.06.2024		95'721	160'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.06.2024		185'318	1'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.06.2024		484'006	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2024		1'334'201	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		63'033'403	70'330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		583'679	1'063'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		32'156'628	5'620'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		10'016'029	8'790'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		44'508'040	46'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		17'371'486	140'645'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		3'200'196	4'915'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		5'709'085	9'650'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		172'876	1'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		1'001'126	175'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		355'994	370'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		736'826	830'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		427'455	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		348'637	310'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		330'000	315'092		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		970'336	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		700'000	622'021		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		2'945'712	3'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.07.2024		1'586'787	1'660'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.07.2024		1'232'510	220'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.07.2024		445'691	394'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.07.2024		452'927	764'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.07.2024		207'176	317'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.07.2024		1'005'197	8'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 12.07.2024		43'090	79'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		1'400'000	1'264'565		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		800'000	775'636		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2024		1'500'000	1'354'020		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.07.2024		340'000'000	1'903'024		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.07.2024		530'000	606'491		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.07.2024		1'400'000	1'358'062		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.07.2024		230'000	151'630		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.07.2024		330'000	198'535		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.07.2024		4'200'000	519'158		CNY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.09.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/CNY Verfall 12.07.2024		2'200'000	271'619	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2024		851'825	950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		65'361'992	72'910'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 09.08.2024		613'455	1'125'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		45'558'519	46'900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		31'604'075	5'675'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		10'470'520	9'104'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		17'698'461	143'675'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 09.08.2024		3'323'545	5'047'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		6'147'553	10'164'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		972'348	1'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2024		650'000	579'114	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		658'880	750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		858'727	900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		515'363	90'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		101'819	90'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		92'140	160'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		328'371	2'700'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		1'545'692	1'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		750'439	800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2024		2'121'420	2'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 09.08.2024		1'190'806	200'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 09.08.2024		411'402	380'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 09.08.2024		236'256	430'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.08.2024		393'776	3'300'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 09.08.2024		745'411	800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.09.2024		66'108'294	76'710'000	CHF/USD		1'127'285.87	0.43	b)
	NZD/CHF Verfall 13.09.2024		583'281	1'125'000	CHF/NZD		-12'991.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 13.09.2024		10'498'494	9'574'000	CHF/GBP		-161'367.96	-0.06	b)
	JPY/CHF Verfall 13.09.2024		35'223'861	5'994'000'000	CHF/JPY		283'326.09	0.11	b)
	EUR/CHF Verfall 13.09.2024		45'904'681	48'645'000	CHF/EUR		264'432.46	0.10	b)
	CNY/CHF Verfall 13.09.2024		18'278'415	151'775'000	CHF/CNY		109'732.26	0.04	b)
	CAD/CHF Verfall 13.09.2024		3'282'890	5'226'000	CHF/CAD		-3'078.35	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 13.09.2024		6'080'968	10'754'000	CHF/AUD		-102'090.61	-0.04	b)
	CHF/JPY Verfall 13.09.2024		165'000'000	970'240	JPY/CHF		-8'412.82	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 13.09.2024		650'000	560'156	USD/CHF		-9'540.98	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 13.09.2024		300'000	282'404	EUR/CHF		-935.37	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 13.09.2024		1'400'000	168'528	CNY/CHF		-936.62	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 13.09.2024		110'000	120'571	GBP/CHF		1'904.61	0.00	b)
	Klasse Nt hedged						1'487'327.58	0.57	
	Devisentermingeschäfte auf Klassen						1'554'007.23	0.59	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'034'538.25	1.16
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	255'616'243.05	97.63
Derivative Finanzinstrumente	1'554'007.23	0.59
Sonstige Vermögenswerte	1'611'733.87	0.62
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	261'816'522.40	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-9'807.60	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	261'806'714.80	

Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	255'616'243.05	97.63
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	1'554'007.23	0.59
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57567333
CAD	1 = CHF	0.62953070
CNY	1 = CHF	0.11971920
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
JPY	100 = CHF	0.58270700
NZD	1 = CHF	0.53083274
USD	1 = CHF	0.84845000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	2'116'494.71	0.808
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	192'817'483.22	73.649

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.09.2023 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
A	CHF	0.10	-	0.10	-
A hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
B	CHF	0.10	-	0.10	-
B hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
It	CHF	0.10	-	0.10	-
It hedged	CHF	0.10	-	0.10	-
Nt	CHF	0.10	-	0.10	-
Nt hedged	CHF	0.10	-	0.10	-

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

Die Währungsbesicherung der Anlagen und allfälligen Guthaben und Forderungen, die nicht auf die Rechnungseinheit des Teilvermögens lauten, ist per 02.05.2024 unvollständig. Die Verletzung wurde zeitnah behoben. Infolge des Verstosses entstand dem Fonds ein Verlust von CHF 114.42. Die Entschädigung des Fonds ist erfolgt.

7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.09.2023 - 31.08.2024

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

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

8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Treasuries Total Return Index Value unhedged CHF

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Ja	CHF	0.80000	0.28000	0.52000
A hedged	Ja	CHF	0.80000	0.28000	0.52000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 03.12.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 06.12.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Ja	CHF	0.85137	0.29797	0.55340
B hedged	Ja	CHF	0.86798	0.30379	0.56419
It	Ja	CHF	0.89000	0.31150	0.57850
It hedged	Ja	CHF	1.367	0.478	0.889
Nt	Ja	CHF	1.530	0.535	0.995
Nt hedged	Ja	CHF	1.594	0.557	1.037

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

bestimmt.

Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

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