

Jahresbericht 2021/2022

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts

Geprüfter Jahresbericht per 31. Mai 2022

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable*

UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable

UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)

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

* ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates



Geprüfter Jahresbericht per 31. Mai 2022

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	3	
Mitteilungen an die Anleger	5	
Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft zu den Jahresrechnungen	7	
UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable*	8	F / CH0503145192
UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable	20	I-X / CH0540307235 P / CH0002791843 Q / CH0203279580 U-X / CH0111018120
UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)	34	P / CH0002788526 Q / CH0203279556
UBS (CH) Bond Fund – Enhanced Yield Short Term (CHF)	50	I-A1/ CH0589362521 I-B/ CH0594826163 I-X / CH0560699891 P / CH0567473944 Q / CH0567473951

* ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates

Verkaufsrestriktionen

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

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

- (i) eine United States Person im Sinne von Paragraph 7701(a)(30) des US Internal Revenue Code von 1986 in der geltenden Fassung sowie der in dessen Rahmen erlassenen Treasury Regulations ist;
- (ii) eine US Person im Sinne von Regulation S des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (17 CFR § 230.902(k)) ist;
- (iii) keine Non-United States Person im Sinne von Rule 4.7 der US Commodity Futures Trading Commission Regulations (17 CFR § 4.7(a)(1)(iv)) ist;

- (iv) sich im Sinne von Rule 202(a)(30)-1 des US Investment Advisers Act von 1940 in der geltenden Fassung in den Vereinigten Staaten aufhält; oder
- (v) ein Trust, eine Rechtseinheit oder andere Struktur ist, die zu dem Zweck gegründet wurde, dass US Persons in diesen Umbrella-Fonds bzw. in die Teilvermögen investieren können.

Internetadresse

www.ubs.com/fonds

Organisation

Fondsleitung

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

Verwaltungsrat

Michael Kehl

Präsident

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Thomas Rose

Vizepräsident

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich
(bis 20.03.2022)

Dr. Daniel Brüllmann

Mitglied (bis 20.03.2022)

Vizepräsident (ab 21.03.2022)

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

André Valente

Delegierter

Managing Director, UBS Fund Management
(Switzerland) AG, Basel

Francesca Gigli Prym

Mitglied

Managing Director, UBS Fund Management
(Luxembourg) S.A., Luxemburg
(ab 21.03.2022)

Dr. Michèle Sennhauser

Mitglied

Executive Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich
(ab 21.03.2022)

Franz Gysin

Unabhängiges Mitglied

Non-executive Director

Werner Strebel

Unabhängiges Mitglied

Non-executive Director

Geschäftsleitung

André Valente

Managing Director

Geschäftsführer und Delegierter des Verwaltungsrates

Eugène Del Cioppo

Managing Director

Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Products

White Labelling Solutions

Urs Fäs

Managing Director

Leiter Real Estate Funds

Christel Müller

Executive Director

Leiterin Corporate Governance & Change Management

Georg Pfister

Managing Director

Leiter Process, Platform, Systems und Leiter Finance, HR

Thomas Reisser

Executive Director

Leiter Compliance

Beat Schmidlin

Executive Director

Leiter Legal Services

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Basel

Delegation der Anlageentscheide

UBS (CH) Bond Fund

– CHF Corporates Sustainable*

– Bonds CHF Sustainable

– Enhanced Yield Short Term (CHF)

* ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates

UBS Asset Management Switzerland AG, Zürich

UBS (CH) Bond Fund

– Global (CHF)

UBS Asset Management (UK) Ltd, London

Delegation weiterer Teilaufgaben

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

Zahlstellen

UBS Switzerland AG, Zürich
und ihre Geschäftsstellen in der Schweiz

Mitteilungen an die Anleger

Fondsvertragsänderungen

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable

UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable

UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)

UBS (CH) Bond Fund

– Enhanced Yield Short Term (CHF)

Mitteilung vom 6. Mai 2021, Nachpublikation vom 9. Juli 2021 (finale Anpassung dargestellt):

1. Bezeichnung; Firma und Sitz von Fondsleitung, Depotbank und Vermögensverwalter (§ 1)

Die Bezeichnung des Teilvermögens «– CHF Corporates» wird in «– CHF Corporates Sustainable» geändert (vgl. Ziff. 2).

2. Anlagepolitik (§ 8)

Die Anlagepolitik des Teilvermögens «– CHF Corporates» wird in Ziff. 2 wie folgt ergänzt:

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich darin, in Unternehmen zu investieren, die Nachhaltigkeitskriterien berücksichtigen und somit ein geeignetes Nachhaltigkeitsprofil aufweisen. Im Research-Prozess, welcher im Prospekt erläutert wird, werden für die Beurteilung der Nachhaltigkeit sowohl interne Nachhaltigkeitsanalysen von UBS Asset Management Switzerland AG als auch solche entsprechend anerkannter Agenturen herangezogen. Bei dieser ESG-Konsensbewertung von UBS (ESG Consensus Score) werden Nachhaltigkeitsfaktoren, wie die Leistung dieser Emittenten in Bezug auf Themen aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG-Aspekte) beurteilt, um im Anlageuniversum Emittenten mit einem überzeugenden Umwelt- und Sozialprofil für das Anlageuniversum zu identifizieren.

Es kommen dabei sowohl Ausschlusskriterien (negatives Screening) als auch ESG Bewertungen (ESG Integration) so-wie eine ESG-basierte Instrumentenauswahl zur Anwendung (Best-in-Class). Zusätzlich kommt, soweit möglich, ein aktives Engagement von Unternehmen zum Tragen, um identifizierte ESG-Risiken und -Chancen im direkten Dialog zielgerichtet zu adressieren (Stewardship-Ansatz). Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

3. Ausgabe und Rücknahme von Anteilen (§ 17)

In § 17 wird klargestellt, dass es sich bei den zusätzlichen Kosten, die bei Ein- und Auszahlung in Effekten statt in bar entstehen, um solche für Handlungen der Fondsleitung, Depotbank oder Drittkosten handelt.

4. Verwendung des Erfolges (§ 22)

In § 22 soll klargestellt werden, dass bis zu 30% des Nettoertrages einer Anteilsklasse, welche auf neue Rechnung vorgetragen werden können, vorgetragene Erträge enthält.

Die Fondsvertragsänderungen wurden am 12. Juli 2021 von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA genehmigt. Die Änderungen traten am 30. Juli 2021 in Kraft.

Mitteilung vom 13. August 2021:

1. Anlagepolitik (§ 8)

Die Anlagepolitik des Teilvermögens «– Bonds CHF Sustainable» wird in Ziff. 2 wie folgt angepasst:

«2. Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich darin, in Emittenten zu investieren, die Nachhaltigkeitskriterien berücksichtigen und somit ein geeignetes Nachhaltigkeitsprofil aufweisen. Im Research-Prozess, welcher im Prospekt erläutert wird, werden für die Beurteilung der Nachhaltigkeit sowohl interne Nachhaltigkeitsanalysen von UBS Asset Management Switzerland AG als auch solche entsprechend anerkannter Agenturen herangezogen. Bei dieser ESG-Konsensbewertung von UBS (ESG Consensus Score) werden Nachhaltigkeitsfaktoren, wie die Leistung dieser Emittenten in Bezug auf Themen aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG-Aspekte) beurteilt, um im Anlageuniversum Emittenten mit einem überzeugenden Umwelt- und Sozialprofil für das Anlageuniversum zu identifizieren. Es kommen dabei sowohl Ausschlusskriterien (negatives Screening) als auch ESG Bewertungen (ESG Integration) sowie eine ESG-basierte Instrumentenauswahl zur Anwendung (Best-in-Class). Zusätzlich kommt, soweit möglich, ein aktives Engagement von Unternehmen zum Tragen, um identifizierte ESG-Risiken und -Chancen im direkten Dialog zielgerichtet zu adressieren (Stewardship-Ansatz). Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

Die Fondsvertragsänderungen wurden am 20. September 2021 von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA genehmigt. Die Änderungen traten am 15. Dezember 2021 in Kraft.

Ausserordentliche Ereignisse

Der Krieg in der Ukraine übt wesentlichen Einfluss auf die weltweiten Finanzmärkte aus, hauptsächlich für russische und ukrainische Finanztitel, aber auch weitere Märkte. Die Lage ist volatil und die Fondsleitung überwacht die

Situation aufmerksam, um rasch angemessene Massnahmen zum Schutz der Anleger treffen zu können. Sie setzt stets die erforderlichen Massnahmen um, um alle gesetzlichen und regulatorischen Vorgaben zu erfüllen, namentlich die kürzlich erlassenen Sanktionsmassnahmen der EU, der Schweiz, dem Vereinigten Königreich und den Vereinigten Staaten von Amerika. Aufgrund ernsthafter Einschränkungen der Handelstätigkeit über sanktionierte russische Titel hinaus wendet sie dort eine «fair value» Bewertung an, wo sie zur Einschätzung gelangt, dass öffentlich verfügbare Preisnotierungen nicht den angemessenen Marktwert wiedergeben. Abhängig von der künftigen Entwicklung der Finanzmärkte könnten sich auch Auswirkungen auf Anlagestrategien ergeben. Es ist derzeit unklar, ob deshalb Liquiditätseinschränkungen in einzelnen Teilvermögen angewendet werden müssen. Solche Massnahmen könnten das gesamte Instrumentarium wie sie in den jeweiligen Prospekten / Fondsverträgen beschrieben sind umfassen.

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft zu den Jahresrechnungen

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Anlagefonds

UBS (CH) Bond Fund

mit den Teilvermögen

- **CHF Corporates Sustainable***
- **Bonds CHF Sustainable**
- **Global (CHF)**
- **Enhanced Yield Short Term (CHF)**

* ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates

bestehend aus den Vermögensrechnungen und den Erfolgsrechnungen, 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) für das am 31. Mai 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems, mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnungen, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern sind. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnungen abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnungen frei von wesentlichen falschen Angaben sind.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in den Jahresrechnungen enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in den Jahresrechnungen als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnungen von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnungen. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entsprechen die Jahresrechnungen für das am 31. Mai 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhängigkeit gemäss Revisionsaufsichtsgesetz erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Basel, 22. September 2022

Ernst & Young AG

Roland Huwiler
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Michael Gurdan
Zugelassener Revisionsexperte

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable [ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates]

Art Effektenfonds

Dreijahresvergleich

	ISIN	31.5.2022	31.5.2021	31.5.2020
Nettofondsvermögen in CHF		1 193 418 340.35	1 116 985 053.83	989 802 131.69
Klasse F	CH0503145192			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		92.89	99.71	97.19
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		93.15	99.95	97.94
Anzahl Anteile im Umlauf		12 847 671,7360	11 202 646,6550	10 184 150,0630

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2021/2022	2020/2021	2019/2020
Klasse F ¹	CHF	-6.7%	2.3%	-

¹ Der Fonds verfügt (gemäss Fondsvertrag) über keine Benchmark, daher erfolgt kein Vergleich der Fondsperformance mit einer Benchmark.

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

Bericht des Portfoliomanagers

Die Zinssätze am Schweizer Kapitalmarkt stiegen im Rechnungsjahr vom 1. Juni 2021 bis zum 31. Mai 2022 über alle Laufzeiten an, wobei die Swapkurve etwas steiler wurde. Die fünfjährigen Swapsätze zogen um 1,39% an. Damit liessen sie den negativen Bereich hinter sich und schlossen bei +0,94%. Die zehnjährigen Renditen kletterten um 1,45% auf +1,41%. Die Kreditrisikoprämien (Spreads) von Unternehmensanleihen gegenüber den Swapsätzen weiteten sich im Februar 2022 infolge der russischen Invasion in der Ukraine massiv aus, erholten sich aber in den folgenden Wochen wieder. Während des Berichtszeitraums blieben die Spreads unverändert bei 35 Basispunkten. Die Schweizerische Nationalbank (SNB) setzte ihre expansive Geldpolitik fort. Sie belies den Leitzins bei -0,75% und belastete Sichteinlagen von Banken weiter mit einem Negativzins von -0,75%. Im Jahr 2021 setzte die SNB ihre Interventionen am Devisenmarkt fort, wobei sie insgesamt Devisen für CHF 21,1 Milliarden kaufte.

Der Subfonds wies eine negative Performance aus, hauptsächlich wegen der nachteiligen Preiseffekte aufgrund der höheren Zinssätze. Die Duration wurde im Vergleich zum Anlageuniversum eher kurz, bei durchschnittlich 4,5 Jahren gehalten. Die Sektorpositionierung – mit Engagements in Hochzinsanleihen, ABS und Agency-Papieren – und die Titelauswahl – mit einer Untergewichtung in Anleihen von russischen Emittenten – trugen positiv zur Wertentwicklung bei.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	42,67
Frankreich	8,47
Vereinigte Staaten	7,18
Deutschland	5,28
Australien	5,07
Spanien	3,97
Grossbritannien	3,62
Neuseeland	2,78
Italien	2,65
Kanada	2,36
Übrige	13,81
Total	97,86

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	31.5.2022	31.5.2021
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	19 713 212.34	19 521 448.06
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 182 775 597.27	1 109 573 964.22
Derivative Finanzinstrumente	807 029.40	0.00
Sonstige Vermögenswerte	5 261 709.33	4 566 388.59
Gesamtfondsvermögen	1 208 557 548.34	1 133 661 800.87
Aufgenommene Kredite	-14 963 125.88	-16 594 291.04
Andere Verbindlichkeiten	-176 082.11	-82 456.00
Nettofondsvermögen	1 193 418 340.35	1 116 985 053.83

Erfolgsrechnung

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	549.14	0.00
Negativzinsen	-86 414.59	-75 435.86
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	7 569 369.77	6 567 080.68
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	646 021.41	381 209.27
Erträge der Effektenleihe	93 651.52	91 303.16
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	330 130.74	617 245.58
Total Ertrag	8 553 307.99	7 581 402.83
Aufwand		
Passivzinsen	-689.18	-0.20
Prüfaufwand	-13 069.40	-13 069.40
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse F	-2 121 276.92	-1 901 574.63
Sonstige Aufwendungen	-25 944.02	-1 685.34
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-133 092.00	-383 399.65
Total Aufwand	-2 294 071.52	-2 299 729.22
Nettoertrag	6 259 236.47	5 281 673.61
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	3 783 483.08	2 381 749.74
Realisierter Erfolg	10 042 719.55	7 663 423.35
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-93 418 159.53	21 764 077.18
Gesamterfolg	-83 375 439.98	29 427 500.53

Verwendung des Erfolges

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	6 259 236.47	5 281 673.61
Vortrag des Vorjahres	389 969.28	1 175 887.11
An die Anleger vorgenommene Zwischenthesaurierung	-4 947 865.99 ²	-6 067 591.44 ³
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1 701 339.76	389 969.28
Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer	-595 468.92	0.00
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg	-1 105 870.84	0.00
Vortrag auf neue Rechnung	0.00	389 969.28

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

² Zwischenthesaurierungen:

Zwischenthesaurierung (Brutto CHF 0.17092 / Ex. Date 27.09.2021 / Valuta 29.09.2021)

Zwischenthesaurierung (Brutto CHF 0.11284 / Ex. Date 20.12.2021 / Valuta 22.12.2021)

Zwischenthesaurierung (Brutto CHF 0.12779 / Ex. Date 21.03.2022 / Valuta 23.03.2022)

³ Zwischenthesaurierungen:

Zwischenthesaurierung (Brutto CHF 0.28848 / Ex. Date 28.09.2020 / Valuta 30.09.2020)

Zwischenthesaurierung (Brutto CHF 0.29063 / Ex. Date 21.12.2020 / Valuta 23.12.2020)

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 116 985 053.83	989 802 131.69
Abgeführte Verrechnungssteuer	-543 977.25	-3 319 519.39
Saldo aus dem Anteilverkehr	160 352 703.75	101 074 941.00
Gesamterfolg	-83 375 439.98	29 427 500.53
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 193 418 340.35	1 116 985 053.83

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
Klasse F	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	11 202 646,6550	10 184 150,0630
Ausgegebene Anteile	2 844 352,7110	2 760 906,7000
Zurückgenommene Anteile	-1 199 327,6300	-1 742 410,1080
Bestand Ende Berichtsperiode	12 847 671,7360	11 202 646,6550
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	1 645 025,0810	1 018 496,5920

Thesaurierung für 2021/2022

Thesaurierung per 10.8.2022

Brutto Thesaurierungsbetrag	CHF	0.13242
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.04635
Thesaurierung netto pro Anteil	CHF	0.08607

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S 0.50000% 20-15.02.29*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 391 133	0,12	
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S 1.37500% 20-15.02.29*	CHF	600 000		600 000	597 929	0,05	
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 1.87500% 20-22.11.29*	CHF	800 000		800 000	799 494	0,07	
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 2.37500% 20-22.11.29*	CHF	300 000		300 000	299 119	0,02	
SWISS AUTO LEASE GMBH-REG-S STEP-UP 20-23.03.30*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 965 977	0,16	
SWISS CAR ABS 2020-1 AG-REG-S 0.62500% 20-18.08.30*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 497 579	0,12	
SWISS CAR ABS-REG-S 0.50000% 21-18.04.31*	CHF	2 330 000		2 330 000	2 308 972	0,19	
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE 2019-REG-S 0.04000% 19-15.06.24*	CHF	9 270 000		9 270 000	9 269 643	0,77	
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 1.75000% 20-15.06.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 987 952	0,16	
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 2.50000% 20-15.06.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	999 215	0,08	
Total CHF					21 117 012	1,75	
Total Asset Backed Securities, fester Zins					21 117 012	1,75	
Asset Backed Securities, variabler Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S STEP-UP 20-15.02.29*	CHF	3 295 000		3 295 000	3 287 963	0,27	
Total CHF					3 287 963	0,27	
Total Asset Backed Securities, variabler Zins					3 287 963	0,27	
Notes, fester Zins							
CHF							
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.95000% 21-25.03.31*	CHF	3 500 000		3 500 000	3 122 000	0,26	
AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEILIG-REG-S 1.45000% 20-23.07.27*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 682 150	0,14	175 000
AT&T INC-REG-S 1.37500% 14-04.12.24*	CHF	2 200 000		2 200 000	2 222 000	0,18	
AXPO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 22-04.02.25*	CHF		2 085 000	2 085 000	2 036 003	0,17	
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.85000% 22-21.01.32*	CHF		3 860 000	3 860 000	3 435 400	0,28	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.18000% 21-20.04.29*	CHF		4 000 000	4 000 000	3 498 000	0,29	
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.07000% 20-18.09.29*	CHF	1 650 000		1 650 000	1 514 700	0,13	
EBN BV-REG-S 0.87500% 14-22.09.26*	CHF	1 000 000		1 000 000			
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.75000% 16-29.11.21*	CHF	3 060 000		3 060 000			
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.05000% 19-09.10.23*	CHF	395 000		395 000			
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.25000% 21-14.02.25*	CHF	3 000 000		3 000 000			
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF		3 850 000	3 850 000	3 742 200	0,31	2 340 000
KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY JSC 3.63800% 14-20.06.22*	CHF	200 000		200 000			
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF	4 265 000		4 265 000	4 100 798	0,34	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26*	CHF		2 000 000	2 000 000			
NANT DE DRANCE SA 1.25000% 15-23.10.23*	CHF	2 000 000		2 000 000			
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25000% 15-30.04.25*	CHF	1 000 000		1 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 12-20.09.29*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 016 000	0,17	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-13.08.27*	CHF	400 000		400 000			
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.62500% 14-16.05.24*	CHF	1 500 000		1 500 000			
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.55000% 19-04.02.28*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 137 000	0,09	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.15000% 20-02.02.29*	CHF	3 200 000		3 200 000	2 876 800	0,24	45 000
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-SUB 4.75000% 12-24.10.22*	CHF	1 475 000		1 475 000	1 484 440	0,12	500 000
REPOWER AG 2.37500% 10-20.07.22*	CHF	105 000		105 000	105 263	0,01	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.50000% 22-25.02.27*	CHF		6 000 000	6 000 000	5 847 000	0,48	
RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS-REG-S 0.89800% 19-03.10.25*	CHF	7 400 000		5 300 000	450 500	0,04	
RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS-REG-S 1.19500% 19-03.04.28*	CHF	4 200 000		1 200 000	240 000	0,02	545 000
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.50000% 20-06.10.25*	CHF	1 375 000	1 000 000	2 375 000	2 341 750	0,19	
SULZER AG 0.87500% 20-18.11.27*	CHF	2 000 000	575 000	2 575 000	2 357 413	0,20	1 215 000
SULZER AG-REG-S 0.80000% 20-23.09.25*	CHF	2 600 000		2 600 000	2 480 400	0,21	
SWISSCOM AG 1.75000% 12-10.07.24*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 064 500	0,25	
TECAN GROUP AG-REG-S 0.05000% 21-06.10.25*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 872 500	0,24	
TRANSPOWER NEW ZEALAND LTD 0.03750% 21-16.03.29*	CHF	1 430 000		1 430 000	1 302 730	0,11	
UBS GROUP AG-REG-S 0.43500% 21-09.11.28*	CHF		6 600 000	6 600 000	6 039 000	0,50	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.19250% 21-24.03.28*	CHF	2 500 000	4 800 000	1 200 000	5 584 550	0,46	
Total CHF					65 553 095	5,42	
Total Notes, fester Zins					65 553 095	5,42	
Notes, Nullcoupon							
CHF							
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.10.30*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 320 750	0,11	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.00000% 21-25.11.22*	CHF	7 000 000		6 000 000	5 989 800	0,50	
Total CHF					7 310 550	0,60	
Total Notes, Nullcoupon					7 310 550	0,60	
Notes, variabler Zins							
CHF							
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGS-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-PRP*	CHF	2 500 000	3 000 000	5 500 000	5 142 500	0,43	1 540 000
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-PRP*	CHF	2 400 000		2 400 000	2 196 000	0,18	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S-SUB 2.250%/VAR 21-PRP*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 362 500	0,20	2 500 000
RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS-REG-S-SUB 3.125%/VAR 21-PRP*	CHF	5 000 000		5 000 000	257 500	0,02	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 1.750%/VAR 21-PRP*	CHF	3 300 000	2 000 000	5 300 000	5 058 850	0,42	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-30.09.41*	CHF		6 000 000	6 000 000	5 400 000	0,45	1 090 000
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.375%/VAR 22-PRP*	CHF		6 000 000	6 000 000	5 370 000	0,44	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-PRP*	CHF	1 675 000		1 675 000	1 530 113	0,13	1 675 000
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 1.500%/VAR 22-03.05.52*	CHF		4 500 000	4 500 000	3 870 000	0,32	
Total CHF					31 187 463	2,58	
Total Notes, variabler Zins					31 187 463	2,58	

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Medium-Term Notes, fester Zins							
CHF							
ABN AMRO BANK NV 0.30000% 16-18.12.24*	CHF	500 000		500 000	493 000	0,04	
ACCOR SA-REG-S 1.75000% 14-27.06.22*	CHF	3 555 000		3 555 000	3 559 977	0,29	
ACHMEA BANK NV 0.50000% 17-03.10.25*	CHF	700 000		700 000	683 900	0,06	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.37500% 18-23.01.23*	CHF	2 075 000		2 075 000			
ADCB FINANCE CAYMAN LTD 0.72500% 18-15.02.24*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 194 000	0,10	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24*	CHF	500 000		500 000	489 250	0,04	
ADECCO SA 0.87500% 20-27.11.25*	CHF	1 000 000	3 500 000	4 500 000	4 475 250	0,37	
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23*	CHF	1 305 000		1 305 000			
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.75000% 18-19.12.22*	CHF	1 800 000		500 000	1 300 000	1 283 750	0,11
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23*	CHF	1 850 000		500 000	1 350 000	1 307 070	0,11
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24*	CHF	2 000 000		400 000	1 600 000	1 478 400	0,12
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN 0.25000% 16-25.10.23*	CHF		1 240 000	1 240 000	1 233 924	0,10	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF	3 500 000		250 000	3 250 000	3 198 000	0,26
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF	2 275 000		2 275 000			
AROUNDTOWN SA-REG-S 1.72000% 19-05.03.26*	CHF	3 400 000		3 400 000			
ASB FINANCE LTD 0.20000% 17-02.08.24*	CHF	9 750 000		9 750 000	9 559 875	0,79	
ASB FINANCE LTD-REG-S 0.11750% 21-29.06.28*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 694 000	0,22	75 000
ASB FINANCE LTD/LONDON-REG-S 0.45000% 19-30.01.25*	CHF	3 000 000	790 000	3 790 000	3 714 200	0,31	
ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.85000% 20-14.10.25*	CHF	2 200 000		2 200 000	2 138 400	0,18	
ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.50000% 21-15.01.27*	CHF	3 600 000		1 600 000	2 000 000	1 869 000	0,15
AUCHAN HOLDING SA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 197 000	0,10	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24*	CHF	2 650 000		2 650 000	2 599 650	0,22	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.25000% 19-24.09.29*	CHF	3 200 000		1 000 000	2 200 000	1 907 400	0,16
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF	4 200 000		4 200 000	3 920 700	0,32	200 000
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF		2 645 000	2 645 000	2 496 880	0,21	385 000
BANCO DEL ESTADO DE CHILE 0.57500% 17-07.04.27*	CHF	2 300 000		2 300 000			
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24*	CHF	2 650 000		2 650 000			
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.24000% 19-06.06.25*	CHF	200 000		200 000			
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.44100% 18-21.12.23*	CHF	1 000 000		300 000	695 100	0,06	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24*	CHF	1 775 000		1 775 000	1 743 938	0,14	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.13500% 19-29.08.29*	CHF	1 600 000		1 600 000			
BANCO SANTANDER SA 0.75000% 17-12.06.23*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 008 800	0,33	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24*	CHF	2 000 000	1 710 000	3 710 000	3 674 755	0,30	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.20000% 19-19.11.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	911 000	0,08	1 000 000
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.31000% 21-09.06.28*	CHF	2 000 000	1 200 000	1 000 000	2 200 000	1 989 900	0,16
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF	6 650 000		6 650 000	6 410 600	0,53	
BANK OF MONTREAL-REG-S 0.05000% 18-30.12.22*	CHF	3 500 000		3 500 000			
BANK OF NEW ZEALAND 0.362500% 21-14.12.29*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 601 100	0,13	
BANK OF NOVA SCOTIA DN-REG-S 0.14250% 21-25.10.28*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 350 750	0,11	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.38500% 22-01.02.29*	CHF	3 900 000	200 000	3 700 000	3 363 300	0,28	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.30250% 21-30.07.31*	CHF	9 000 000		9 000 000	7 614 000	0,63	3 380 000
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.25000% 19-10.07.25*	CHF	500 000		500 000	486 000	0,04	
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 19-12.06.26*	CHF	500 000		500 000	475 250	0,04	
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL 0.25000% 19-24.10.29*	CHF	100 000		100 000			
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 20-03.11.28*	CHF	2 700 000		2 700 000	2 423 250	0,20	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT 0.55000% 15-08.12.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	998 000	0,08	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.60000% 17-05.04.27*	CHF	2 400 000		2 400 000	2 287 200	0,19	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.40000% 19-12.02.24*	CHF	800 000		800 000	794 800	0,07	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 1.00000% 18-13.11.26*	CHF	2 000 000		500 000	1 500 000	1 465 500	0,12
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.25000% 21-21.06.29*	CHF	2 500 000	1 530 000	970 000	859 905	0,07	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.36600% 18-10.10.24*	CHF	150 000		150 000	147 750	0,01	
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA 0.55000% 16-11.10.22*	CHF	650 000		650 000			
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S 1.00000% 19-10.07.25*	CHF	1 300 000		300 000	1 000 000	977 500	0,08
BARCLAYS PLC 0.31500% 21-04.06.27*	CHF	5 600 000		5 600 000	5 191 200	0,43	
BARCLAYS PLC-REG-S 1.12500% 18-12.07.23*	CHF	800 000		800 000	804 640	0,07	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.05000% 20-28.01.31*	CHF	1 500 000		1 500 000			
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.62500% 14-08.09.21*	CHF	4 800 000		4 800 000			
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 14-08.09.26*	CHF	1 500 000		1 500 000			
BERLIN HYP AG 0.25000% 20-11.09.28*	CHF	1 000 000	5 045 000	6 045 000	5 537 220	0,46	
BERLIN HYP AG 0.25000% 21-04.10.29*	CHF	4 750 000		4 750 000	4 244 125	0,35	
BERLIN-HANNOVERSCHE HYPOTHKNBNK-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 296 000	0,11	
BKW AG-REG-S 0.25000% 19-29.07.27*	CHF	150 000		150 000			
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24*	CHF	1 000 000		300 000	700 000	693 000	0,06
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.75000% 19-03.09.27*	CHF	3 000 000	200 000	2 800 000	2 724 400	0,23	300 000
BNP PARIBAS 1.87500% 12-12.09.22*	CHF	200 000		200 000			
BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28*	CHF	4 600 000		4 600 000	4 298 700	0,36	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.30000% 19-15.10.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	911 500	0,08	1 000 000
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.15000% 20-10.03.28*	CHF	4 600 000		4 600 000	4 211 300	0,35	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.14750% 21-13.07.27*	CHF	14 400 000		14 400 000	13 449 600	1,11	
BNP PARIBAS-REG-S 0.50000% 21-16.03.29*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 088 400	0,09	
BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25*	CHF	2 750 000		2 750 000	2 722 500	0,23	
BNP PARIBAS-SUB 1.75000% 15-05.06.25*	CHF	380 000		380 000	381 330	0,03	380 000
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.11100% 20-24.07.28*	CHF	6 900 000		6 900 000	6 247 950	0,52	
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF	4 900 000		1 900 000	3 000 000	2 955 000	0,24
BPCE SA-REG-S 0.50000% 19-08.11.23*	CHF	1 750 000		1 750 000			
CAIXABANK SA-REG-S 0.47700% 21-01.07.27*	CHF	9 400 000		9 400 000	8 765 500	0,73	
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.15000% 18-31.07.23*	CHF	1 650 000	840 000	1 650 000	840 000	836 808	0,07
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.05000% 19-15.10.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	935 500	0,08	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.28250% 22-03.02.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 877 000	0,16	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.96750% 22-26.04.29*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 946 000	0,24	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 1.11500% 18-17.10.22*	CHF	1 000 000		1 000 000			
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF	550 000		550 000	546 370	0,05	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24*	CHF	3 500 000		3 500 000	3 437 000	0,28	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF	4 300 000		600 000	3 700 000	3 626 000	0,30
CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26*	CHF		3 860 000	3 860 000	3 638 050	0,30	275 000
CELLNEX TELECOM SA 1.11750% 20-17.07.25*	CHF	2 715 000	1 220 000	3 935 000	3 809 080	0,32	120 000
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 0.77500% 20-18.02.27*	CHF	6 350 000	200 000	6 550 000	5 927 750	0,49	3 510 000
CIE DE FINANCIAMIENTO FONCIER SA-REG-S 0.89000% 22-27.04.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 956 000	0,16	
CITIGROUP INC 0.50000% 17-22.11.24*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 183 200	0,10	
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26*	CHF	7 240 000	690 000	7 930 000	7 692 100	0,64	
CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 19-01.11.28*	CHF	3 450 000	295 000	3 745 000	3 424 803	0,28	
CITIGROUP INC-REG-S 0.25000% 21-30.08.29*	CHF	4 500 000		4 500 000	3 942 000	0,33	
COMMERZBANK AG-REG-S 1.10000% 18-11.07.25*	CHF	2 000 000	1 000 000	3 000 000	2 916 000	0,24	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.40000% 17-25.09.26*	CHF	1 200 000	925 000	600 000	1 525 000	1 464 763	0,12
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.11300% 19-10.12.29*	CHF	2 000 000		200 000	1 800 000	1 593 900	0,13
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.18750% 21-08.12.28*	CHF	1 800 000	1 800 000	1 800 000	1 643 400	0,14	
COOPERATIVA PERSONAL UNIV CHILE-REG-S 1.05000% 17-15.10.21*	CHF	1 180 000		1 180 000			
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.00000% 14-05.02.24*	CHF	1 250 000		1 250 000			

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.50000% 14-01.12.28*	CHF	3 200 000		3 200 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.15000% 16-24.02.22*	CHF	3 000 000		3 000 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 975 000	0,16	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	2 200 000		400 000	1 800 000	1 815 120	0,15	
CREDIT AGRICOLE SA 0.21250% 21-21.06.29*	CHF		3 000 000	200 000	2 800 000	2 478 000	0,21	
CREDIT AGRICOLE SA 0.41000% 22-18.01.30*	CHF		2 300 000		2 300 000	2 025 150	0,17	490 000
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 2.12500% 14-30.10.24*	CHF	200 000			200 000	205 600	0,02	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 15-15.09.23*	CHF		295 000		295 000	295 177	0,02	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.55000% 16-14.12.26*	CHF	200 000			200 000	191 300	0,02	155 000
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.45000% 17-14.03.22*	CHF	3 700 000		3 700 000				
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 485 750	0,12	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 19-07.11.25*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 161 500	0,18	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.12750% 20-27.07.28*	CHF	4 170 000	400 000		4 570 000	4 092 435	0,34	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF	3 400 000			3 400 000	3 218 100	0,27	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	1 697 000	0,14	1 125 000
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.16370% 21-28.04.28*	CHF		1 000 000	200 000	800 000	728 400	0,06	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 17-12.07.24*	CHF	4 700 000	1 000 000		5 700 000	5 637 300	0,47	255 000
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S SUB 0.25000% 19-10.10.29*	CHF	100 000			100 000	87 600	0,01	
CREDIT SUISSE GROUP AG 1.00000% 15-14.04.23*	CHF	5 700 000			5 700 000	5 703 990	0,47	
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.25000% 18-14.11.22*	CHF	1 120 000		1 120 000				
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.85000% 18-14.11.25*	CHF	360 000			360 000	356 580	0,03	
DANSKE BANK AS-REG-S 0.62500% 19-24.11.22*	CHF	600 000		600 000				
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 19-19.06.34*	CHF	500 000			500 000	426 500	0,04	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.20000% 21-20.05.33*	CHF	3 000 000		3 000 000				
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.10000% 21-28.01.36*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 349 000	0,19	225 000
DEUTSCHE BANK AG 0.31500% 21-14.09.27*	CHF		5 000 000		5 000 000	4 467 500	0,37	
DEUTSCHE BANK AG 0.62500% 15-19.12.23*	CHF	2 450 000			2 450 000	2 434 075	0,20	
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 16-05.07.21*	CHF	1 290 000		1 290 000				
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 17-21.03.22*	CHF	5 150 000		5 150 000				
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 18-08.02.23*	CHF	3 200 000	4 050 000		7 250 000	7 248 550	0,60	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 344 800	0,19	
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.30000% 16-02.11.21*	CHF	500 000		500 000				
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG-S 0.43500% 20-06.02.32*	CHF	7 500 000	3 000 000	1 000 000	9 500 000	8 307 750	0,69	
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 452 750	0,29	
DNB BANK ASA-REG-S 1.16750% 22-03.06.27*	CHF		4 000 000		4 000 000	3 964 000	0,33	
DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24*	CHF		1 300 000		1 300 000	1 279 200	0,11	
DVB BANK SE 0.57500% 15-17.06.22*	CHF	1 900 000			1 900 000	1 899 810	0,16	
EBN BV 1.62500% 11-03.10.23*	CHF	2 300 000		2 300 000				
ELECTRICITE DE FRANCE 0.30000% 16-14.10.24*	CHF	2 200 000	145 000		2 345 000	2 312 170	0,19	
ELI LILLY & CO-REG-S 0.15000% 16-24.05.24*	CHF	3 500 000	1 275 000	350 000	4 425 000	4 387 388	0,36	
ELI LILLY & CO-REG-S 0.45000% 16-24.05.28*	CHF	1 630 000			1 630 000	1 538 720	0,13	
EMIRATES NBD PJSC 0.62500% 18-09.02.23*	CHF	4 750 000		4 750 000				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 4.00000% 12-26.10.27*	CHF		650 000		650 000	734 500	0,06	200 000
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.55000% 17-03.09.24*	CHF	4 400 000			4 400 000	4 367 000	0,36	
ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 0.25000% 21-02.10.28*	CHF	5 100 000			5 100 000	4 582 350	0,38	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.38250% 18-11.07.24*	CHF	1 500 000		1 500 000				
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.07000% 19-18.10.27*	CHF	2 450 000		600 000	1 850 000	1 702 000	0,14	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23*	CHF	1 200 000	390 000		1 590 000	1 585 548	0,13	1 200 000
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24*	CHF	2 050 000			2 050 000	2 021 300	0,17	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25*	CHF	6 000 000	1 500 000	300 000	7 200 000	6 933 600	0,57	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.06800% 21-31.03.27*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 325 000	0,19	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 821 500	0,23	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF	2 500 000		2 500 000		2 475 000	0,20	
FORD MOTOR CREDIT CO-REG-S 2.12500% 20-04.12.23*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 009 000	0,25	
GLENCORE CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 1.00000% 20-30.03.27*	CHF	4 000 000		1 000 000	3 000 000	2 866 500	0,24	540 000
GLENCORE CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 0.50000% 21-07.09.28*	CHF		300 000		300 000	267 000	0,02	300 000
GLENCORE FINANCE EUROPE LTD-REG-S 0.35000% 19-10.09.25*	CHF	4 925 000			4 925 000	4 700 913	0,39	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.50000% 17-04.12.24*	CHF	700 000			700 000	690 200	0,06	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF	1 050 000			1 050 000	1 034 775	0,09	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.40000% 21-11.05.28*	CHF	3 000 000	300 000		3 300 000	2 979 900	0,25	
HEATHROW FUNDING LTD 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 975 000	0,16	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.45000% 19-15.10.26*	CHF	1 350 000	5 400 000	600 000	6 150 000	5 787 150	0,48	2 015 000
HENKEL AG & CO KGAA 0.27250% 20-28.04.23*	CHF	3 000 000		3 000 000				
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.32000% 21-03.11.27*	CHF		7 600 000		7 600 000	6 961 600	0,58	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.81250% 21-03.11.31*	CHF		5 600 000		5 600 000	4 785 200	0,40	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26*	CHF		4 000 000		4 000 000	3 980 000	0,33	
HYPONOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24*	CHF	700 000			700 000	682 850	0,06	
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S 0.45000% 18-05.03.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
HYPONORARLBERG BANK-REG-S 0.25000% 18-12.11.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S SUB 1.62500% 19-29.11.29*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 760 000	0,31	805 000
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S 0.12500% 19-03.09.29*	CHF	1 865 000			1 865 000			
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S 0.12500% 21-23.08.28*	CHF	1 665 000			1 665 000			
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.69500% 18-27.06.23*	CHF	1 150 000			1 150 000			
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.73250% 19-26.02.24*	CHF	1 800 000			1 800 000			
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.26000% 20-11.02.25*	CHF	1 600 000			1 600 000			
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.75250% 20-06.07.23*	CHF	2 500 000			2 500 000			
INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.02190% 19-16.07.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24*	CHF	2 800 000	10 400 000		13 200 000	12 863 400	1,06	
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND 0.37500% 17-18.07.25*	CHF	1 260 000		1 260 000				
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.30000% 18-18.12.23*	CHF	2 000 000		2 000 000				
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-14.07.28*	CHF	3 350 000		3 350 000				
JPMORGAN CHASE & CO 0.50000% 15-04.12.23*	CHF	3 200 000		3 200 000				
JPMORGAN CHASE & CO 0.45000% 16-11.11.26*	CHF	500 000			500 000	479 250	0,04	180 000
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.63000% 20-25.02.35*	CHF	2 600 000			2 600 000	2 040 737	0,17	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.80000% 22-03.02.32*	CHF		5 800 000		5 800 000	5 073 331	0,42	
KIWIBANK LTD-REG-S 0.25000% 18-18.10.23*	CHF	1 000 000		1 000 000				
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25*	CHF	2 025 000			2 025 000			
KOREA EXPRESSWAY CORP 0.25000% 17-07.06.24*	CHF	1 000 000			1 000 000			
KOREA GAS CORP-REG-S 0.20750% 18-02.08.23*	CHF	1 000 000			1 000 000			
KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO-REG-S 0.05000% 19-19.07.27*	CHF	2 055 000			2 055 000			
KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 0.19250% 20-15.06.25*	CHF	855 000			855 000			
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.37300% 18-01.06.23*	CHF	1 890 000			1 890 000			
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.26250% 20-30.07.27*	CHF	1 520 000			1 520 000			
KOREA WATER RESOURCES CORP-REG-S 0.15000% 18-20.09.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	994 300	0,08	
KOREA WESTERN POWER CO LTD-REG-S 0.12500% 19-27.02.24*	CHF	200 000		200 000				
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FINANCE-REG-S 1.05000% 20-11.04.22*	CHF	1 500 000		1 500 000				
LGT BANK AG-REG-S 0.37500% 19-05.07.28*	CHF	4 600 000		4 600 000				
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25*	CHF	2 910 000	1 000 000		3 910 000	3 868 945	0,32	
LLOYDS BANKING GROUP 0.60250% 22-09.02.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 819 000	0,15	
MACQUARIE BANK 0.75000% 16-05.02.24*	CHF	700 000			700 000	699 650	0,06	
MACQUARIE BANK LTD 0.62500% 15-04.09.23*	CHF	2 250 000		2 250 000				
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 0.39500% 21-20.07.28*	CHF		13 200 000	200 000	13 000 000	11 654 500	0,96	
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 1.28500% 22-11.09.29*	CHF		9 500 000		9 500 000	8 830 250	0,73	4 900 000
MBANK SA-REG-S 0.56500% 18-07.06.22*	CHF	350 000	1 885 000		2 235 000	2 234 799	0,18	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 925 000	0,24	
MCDONALD'S CORP 0.17000% 16-04.10.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 968 000	0,16	
MEDIOBANCA INTERNATIONAL LUX SA-REG-S 0.55000% 18-02.03.23*	CHF	10 150 000			10 150 000	10 154 060	0,84	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 19-11.06.27*	CHF	1 150 000		1 150 000				
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-25.09.28*	CHF	3 000 000		3 000 000				
MFINANCE FRANCE SA 1.00500% 17-28.03.23*	CHF	1 200 000	2 620 000		3 820 000	3 801 282	0,31	
MIGROS BANK AG-REG-S 0.25000% 19-10.12.27*	CHF	2 500 000		2 500 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.30000% 17-20.12.24*	CHF	200 000			200 000	195 200	0,02	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.12500% 19-18.11.27*	CHF	3 500 000	1 000 000		4 500 000	4 146 750	0,34	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25*	CHF	1 600 000			1 600 000	1 525 600	0,13	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK-REG-S 0.40000% 22-25.02.26*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 883 000	0,24	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 18-13.03.24*	CHF	4 500 000		2 350 000	2 150 000	2 130 650	0,18	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.12500% 19-21.06.27*	CHF	3 150 000		1 550 000	1 600 000	1 496 000	0,12	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.06500% 20-29.01.29*	CHF	1 200 000	2 000 000	1 200 000	2 000 000	1 796 000	0,15	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.12500% 19-13.09.23*	CHF	600 000			600 000	596 160	0,05	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF		4 400 000		4 400 000	4 336 200	0,36	
NESTLE HOLDINGS INC 0.25000% 17-04.10.27*	CHF	300 000			300 000	287 850	0,02	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 19-18.10.27*	CHF	1 200 000		1 200 000				
NORDEA BANK ABP 0.25000% 15-27.11.23*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 987 600	0,16	
NORDEA BANK ABP 0.55000% 15-23.06.25*	CHF	4 700 000	1 300 000	250 000	5 750 000	5 652 250	0,47	
ONTARIO, PROVINCE OF-REG-S 0.05000% 21-12.05.33*	CHF	1 500 000		1 500 000				
ORANGE SA-REG-S 0.20000% 19-24.11.25*	CHF	300 000			300 000	290 400	0,02	
ORANGE SA-REG-S 0.62500% 19-22.06.29*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 681 200	0,14	
PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.75000% 22-02.05.29*	CHF		3 500 000		3 500 000	3 473 750	0,29	
PETROLEOS MEXICANOS 2.37500% 16-14.12.21*	CHF	11 580 000		11 580 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 17-25.01.35*	CHF	2 000 000		2 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-12.10.27*	CHF	200 000		200 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.75000% 17-18.10.38*	CHF	2 000 000		2 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.12500% 19-08.05.29*	CHF	1 000 000		1 000 000				
QNB FINANCE LTD-REG-S 0.02500% 21-03.06.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 883 050	0,40	
QUEBEC, PROVINCE OF 0.03000% 21-18.06.31*	CHF	1 000 000		1 000 000				
RABOBANK NEDERLAND NV 3.50000% 07-31.08.23*	CHF		440 000		440 000	457 116	0,04	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 19-25.11.27*	CHF	2 200 000	5 000 000		7 200 000	6 638 400	0,55	
RABOBANK NEDERLAND NV 1.36250% 22-28.04.28*	CHF		1 800 000		1 800 000	1 763 100	0,15	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.177500% 21-15.01.27*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 378 750	0,20	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.57000% 21-15.01.31*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 342 500	0,11	
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26*	CHF	6 000 000	2 300 000		8 300 000	7 831 050	0,65	
RCI BANQUE SA 0.50000% 17-20.04.22*	CHF	4 630 000		4 630 000				
RCI BANQUE SA 0.50000% 19-18.07.24*	CHF	2 700 000			2 700 000	2 632 500	0,22	
RCI BANQUE SA-REG-S 0.55000% 18-30.05.23*	CHF	200 000	2 950 000		3 150 000	3 135 195	0,26	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.20000% 21-22.09.31*	CHF		6 000 000	1 000 000	5 000 000	4 140 000	0,34	2 030 000
ROYAL BANK OF CANADA DN-REG-S 0.25000% 21-15.10.29*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 326 750	0,11	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.62500% 18-24.10.22*	CHF	200 000		200 000				
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.15000% 19-10.12.24*	CHF	4 900 000			4 900 000	4 782 400	0,40	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 879 000	0,16	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.37500% 15-21.08.23*	CHF	3 000 000		3 000 000				
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.87500% 15-21.08.28*	CHF	5 900 000		5 900 000				
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 0.76000% 15-17.06.22*	CHF	4 050 000			4 050 000	4 046 760	0,33	
SITEX PROPERTIES AG 0.37500% 20-17.06.25*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 462 500	0,20	
SOCIETE GENERALE 0.37500% 21-26.07.28*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 621 800	0,13	400 000
SOCIETE GENERALE 0.40000% 17-22.02.22*	CHF	1 200 000		1 200 000				
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 19-08.10.26*	CHF	5 200 000	200 000		5 400 000	5 027 400	0,42	800 000
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 20-25.02.27*	CHF	6 400 000			6 400 000	5 830 400	0,48	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.74500% 22-26.01.29*	CHF		2 800 000		2 800 000	2 560 600	0,21	400 000
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.70000% 18-26.02.25*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 346 000	0,19	1 000 000
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.87500% 19-28.02.24*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 397 900	0,12	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 19-11.12.25*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 102 850	0,09	
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 21-15.09.28*	CHF		1 000 000		1 000 000	900 500	0,07	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.35000% 19-06.03.29*	CHF	130 000			130 000	120 445	0,01	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.25000% 19-11.10.23*	CHF	250 000			250 000	249 000	0,02	
SWISS REINSURANCE CO LTD 0.75000% 15-21.01.27*	CHF	2 000 000	2 000 000		4 000 000	3 898 000	0,32	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 1.62500% 14-01.11.24*	CHF	2 980 000			2 980 000	2 962 120	0,25	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 2.12500% 14-01.11.29*	CHF	300 000			300 000	291 000	0,02	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24*	CHF	2 000 000		2 000 000				
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 0.50000% 15-01.06.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	955 000	0,08	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.28800% 18-13.07.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 920 000	0,16	575 000
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.000001% 21-21.05.24*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 909 972	0,32	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.62500% 16-23.06.23*	CHF	1 000 000	5 115 000		6 115 000	6 121 727	0,51	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.65000% 16-02.11.26*	CHF	2 850 000			2 850 000	2 714 625	0,22	1 100 000
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 1.00000% 18-08.12.25*	CHF	2 900 000			2 900 000	2 850 700	0,24	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 0.87500% 21-19.11.31*	CHF	4 700 000	5 000 000	1 700 000	8 000 000	6 932 000	0,57	2 710 000
UBS AG LONDON BRANCH-REG-S 0.15000% 21-29.06.28*	CHF		9 200 000	2 000 000	7 200 000	6 570 000	0,54	
UBS GROUP AG-REG-S 0.87500% 19-30.01.25*	CHF	4 400 000			4 400 000	4 384 600	0,36	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.37500% 17-31.05.23*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 398 800	0,20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 743 300	0,14	
VODAFONE GROUP PLC 0.37500% 16-03.12.24*	CHF	2 000 000		400 000	1 600 000	1 576 800	0,13	
VODAFONE GROUP PLC 0.50000% 16-19.09.31*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 590 300	0,13	1 545 000
VODAFONE GROUP PLC 0.62500% 17-15.03.27*	CHF	450 000			450 000	435 375	0,04	250 000
WELLS FARGO & CO 0.37500% 15-02.06.22*	CHF	600 000		600 000				
WELLS FARGO & CO-REG-S 0.75000% 20-27.05.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
WELLS FARGO & CO-REG-S 1.12500% 20-26.05.28*	CHF	400 000		400 000				
WESTPAC BANKING CORP 0.40000% 15-09.06.23*	CHF	1 500 000			1 500 000			
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.30000% 17-28.11.25*	CHF	300 000		300 000				
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.50000% 18-16.05.28*	CHF	200 000		200 000				
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.40000% 18-06.06.24*	CHF	3 300 000			3 300 000	3 268 650	0,27	
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.37500% 16-05.02.24*	CHF	2 080 000		2 080 000				
WOODSIDE FINANCE LTD 1.00000% 16-11.12.23*	CHF	900 000			900 000	902 700	0,07	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 0.10000% 20-27.08.32*	CHF	4 500 000			4 500 000	3 737 250	0,31	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 1.12500% 22-04.07.29*	CHF		6 000 000		6 000 000	5 838 000	0,48	
Total CHF						606 026 211	50,14	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						606 026 211	50,14	
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
CHF								
BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 0.00000% 19-24.09.21*	CHF	2 700 000		2 700 000				
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 21-27.01.33*	CHF	1 000 000			1 000 000	834 500	0,07	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.00000% 19-27.05.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO-REG-S 0.00000% 19-19.07.24*	CHF	1 450 000		1 450 000				
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 0.00000% 21-26.08.31*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 690 000	0,14	150 000
Total CHF						2 524 500	0,21	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon						2 524 500	0,21	

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Medium-Term Notes, variabler Zins							
CHF							
VTB BK OJSC VIA VTB CPTL SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-24.10.24*	CHF	300 000					
Total CHF						0,00	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins							
0,00							
Anleihen, fester Zins							
CHF							
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.01000% 20-18.02.30*	CHF	1 000 000			1 000 000		
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.01000% 20-29.06.28*	CHF	565 000			565 000		
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.40000% 17-20.09.27*	CHF	70 000			70 000	64 925	0,01
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 1.05000% 20-26.05.23*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 512 750	0,21
ALLREAL HOLDING AG 0.62500% 16-10.05.24*	CHF	800 000			800 000	792 800	0,07
ALLREAL HOLDING AG 0.60000% 21-15.07.30*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 692 500	0,22
ALLREAL HOLDING AG 1.37500% 15-31.03.25*	CHF	150 000			150 000	150 150	0,01
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-19.06.26*	CHF	50 000			50 000	48 475	0,00
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.50000% 18-19.04.23*	CHF	2 050 000			2 050 000	2 050 615	0,17
AMAG LEASING AG-REG-S 0.35000% 17-27.10.21*	CHF	2 290 000			2 290 000		
AMAG LEASING AG-REG-S 0.87500% 17-25.10.24*	CHF	1 930 000			1 930 000	1 904 910	0,16
AMAG LEASING AG-REG-S 0.55000% 18-10.02.23*	CHF	200 000			200 000	199 800	0,02
AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 19-12.07.22*	CHF	115 000			115 000	114 977	0,01
AMAG LEASING AG-REG-S 0.50000% 19-12.11.25*	CHF	2 250 000			2 250 000	2 152 125	0,18
AMAG LEASING AG-REG-S 0.25000% 21-27.10.23*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 466 250	0,20
AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 20-12.02.24*	CHF	5 565 000			5 565 000	5 448 135	0,45
AMGEN INC 0.41000% 16-08.03.23*	CHF	1 000 000			1 000 000		
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN 0.25000% 17-22.09.25*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 128 500	0,18
APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24*	CHF	3 000 000			250 000	2 736 250	0,23
APPLE INC-REG-S 0.75000% 15-25.02.30*	CHF	150 000			150 000		
AXPO HOLDING AG 1.00200% 20-23.07.27*	CHF		800 000		800 000	774 000	0,06
AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24*	CHF	200 000	3 000 000		3 200 000	3 252 800	0,27
AXPO HOLDING AG 3.12500% 10-26.02.25*	CHF		7 370 000		7 370 000	7 742 185	0,64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26*	CHF	6 000 000	3 200 000		9 200 000	8 588 200	0,71
BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23*	CHF	200 000			200 000		
BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24*	CHF	5 985 000	3 000 000		8 985 000	8 562 705	0,71
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.87500% 18-14.12.21*	CHF	2 310 000	200 000		2 510 000		
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 1.55000% 19-11.10.22*	CHF	1 050 000	2 000 000		3 050 000	3 047 255	0,25
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	1 350 000	1 000 000		2 000 000	341 775	0,03
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.12500% 17-20.07.27*	CHF	1 050 000	900 000		1 950 000	1 861 275	0,15
BANK JULIUS BAER & CO AG-REG-S 0.12500% 21-27.04.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 820 000	0,15
BANK OF NOVA SCOTIA 0.73250% 22-25.04.29*	CHF		700 000		700 000	675 500	0,06
BANQUE CANTONALE DE GENEVE-SUB 1.12500% 17-28.06.27*	CHF	240 000			240 000	232 080	0,02
BANQUE CANTONALE VAUDOISE 0.40000% 16-07.04.31*	CHF	150 000			150 000	135 150	0,01
BASELANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.60000% 22-13.05.32*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 027 500	0,42
BASELANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.60000% 22-13.05.32*	CHF		5 000 000		5 000 000		
BASLER KANTONALBANK 0.12500% 20-10.09.32*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 408 000	0,20
BELL FOOD GROUP AG 0.62500% 16-24.03.25*	CHF	100 000			100 000		
BELL FOOD GROUP AG 1.75000% 13-16.05.22*	CHF	1 000 000			1 000 000		
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.37500% 18-01.02.24*	CHF	2 200 000			2 200 000		
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.75000% 18-01.02.28*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 413 750	0,12
BERNER KANTONALBANK AG 0.10000% 19-30.09.39*	CHF	80 000			80 000	58 080	0,00
BKW AG-REG-S 0.75000% 18-15.10.25*	CHF	200 000			200 000		
BKW FMB ENERGIE AG 2.50000% 10-15.10.30*	CHF	150 000			150 000		
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23*	CHF	905 000			905 000		
BOBST GROUP SA-REG-S 1.12500% 18-27.09.24*	CHF	100 000			100 000	100 300	0,01
BOBST GROUP SA-REG-S 0.50000% 20-17.02.26*	CHF	2 515 000			2 515 000	2 408 113	0,20
BUEHLER HOLDING AG-REG-S 0.10000% 17-21.12.22*	CHF	1 400 000			1 400 000		
BUEHLER HOLDING AG-REG-S 0.60000% 17-21.12.26*	CHF	200 000			200 000	192 600	0,02
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 1.25000% 14-14.10.22*	CHF	500 000			500 000	502 350	0,04
CEMBRA MONEY BANK AG 0.18000% 16-05.10.23*	CHF	700 000			700 000	694 050	0,06
CEMBRA MONEY BANK AG 0.37500% 17-27.06.25*	CHF	200 000			200 000	194 400	0,02
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.25000% 17-23.05.24*	CHF	2 700 000	2 500 000		5 200 000	5 114 200	0,42
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.28500% 19-19.08.27*	CHF	150 000			150 000	138 900	0,01
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.87500% 18-08.06.26*	CHF	250 000			250 000	243 500	0,02
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.41750% 21-15.11.28*	CHF		8 920 000		8 920 000	8 099 360	0,67
CLARIANT AG 3.50000% 12-26.09.22*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 036 800	0,33
CLARIANT AG-REG-S 1.12500% 19-15.04.26*	CHF	250 000	4 000 000		4 250 000	4 177 750	0,35
CLARIANT AG-REG-S 2.12500% 14-17.10.24*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 066 000	0,34
COCA-COLA CO/THE 1.00000% 15-02.10.28*	CHF	2 200 000			700 000	1 476 000	0,12
COMET HOLDING AG-REG-S 1.30000% 21-20.04.26*	CHF	985 000			985 000	975 150	0,08
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.87500% 15-31.07.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 995 000	0,17
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26*	CHF	800 000			800 000	776 000	0,06
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.75000% 18-06.06.25*	CHF	200 000			200 000	197 400	0,02
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.75000% 20-05.05.23*	CHF	4 000 000			4 000 000		
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.30000% 17-07.04.25*	CHF	3 000 000			3 000 000		
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.12500% 21-09.04.31*	CHF	800 000			800 000	707 200	0,06
DAETWYLER HOLDING AG-REG-S 0.62500% 18-30.05.24*	CHF	250 000			250 000	248 750	0,02
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23*	CHF	4 200 000			4 200 000	4 180 260	0,35
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.20000% 21-15.12.26*	CHF		7 000 000		7 000 000	6 412 000	0,53
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.55000% 21-16.04.29*	CHF		6 250 000		6 250 000	5 384 375	0,45
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 1.70000% 22-30.03.27*	CHF		4 000 000		4 000 000	3 872 000	0,32
DORMAKABA FINANCE AG 0.37500% 17-13.10.21*	CHF	5 450 000			5 450 000		
DORMAKABA FINANCE AG 1.00000% 17-13.10.25*	CHF	200 000			200 000	197 000	0,02
DUFREY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26*	CHF	3 400 000			3 400 000	3 175 600	0,26
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.45000% 17-11.07.22*	CHF	200 000			200 000	200 060	0,02
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.87500% 18-18.10.23*	CHF	3 600 000			3 600 000	3 605 400	0,30
EMISSIONS- UND FINANZ AG-REG-S 0.37500% 21-06.05.26*	CHF	1 870 000			1 870 000	1 788 655	0,15
EMMI FINANZ AG 0.50000% 17-21.06.29*	CHF	150 000			150 000	138 975	0,01
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.10000% 19-23.10.23*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 963 200	0,33
FERRING HOLDING SA-REG-S 1.05000% 20-09.07.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 964 000	0,25
FIRMENICH INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 20-19.12.23*	CHF	5 000 000	1 500 000		3 500 000	3 510 500	0,29
FLUGHAFEN ZUERICH AG 1.50000% 13-17.04.23*	CHF	500 000			500 000	505 150	0,04
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.20000% 20-26.02.35*	CHF	2 300 000			2 300 000	1 812 400	0,15
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.70000% 20-22.05.24*	CHF	925 000			925 000	921 763	0,08
FLUGHAFEN ZUERICH AG 0.62500% 17-24.05.29*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 394 250	0,12
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.55600% 21-03.09.26*	CHF	3 200 000			2 000 000	1 912 000	0,16
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.79500% 21-01.12.28*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 858 000	0,15
FREIBURGER KANTONALBANK 0.10000% 19-01.11.44*	CHF	1 000 000			1 000 000		
GALENICA SANTE LTD 1.00000% 17-15.12.26*	CHF	240 000			240 000	236 040	0,02
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.75000% 16-30.11.21*	CHF	12 875 000			12 875 000		
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM 2.25000% 17-19.07.22*	CHF	750 000			750 000		

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S 1.450000% 18-06.03.23*	CHF	4 000 000		4 000 000				
GEBERIT AG 0.750000% 22-29.09.27*	CHF		1 300 000		1 300 000	1 270 750	0,11	
GEBERIT AG-REG-S 0.100000% 19-17.10.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	986 000	0,08	
GEBERIT AG-REG-S 0.350000% 20-20.10.22*	CHF	1 800 000		1 800 000				
GEORG FISCHER LTD-REG-S 0.950000% 20-25.03.30*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 001 600	0,25	
GIVAUDAN FINANCE SA-REG-S 0.125000% 21-07.06.27*	CHF		1 935 000		1 935 000	1 819 868	0,15	845 000
GIVAUDAN SA-REG-S 0.375000% 18-09.04.25*	CHF	1 000 000	2 000 000		3 000 000	2 955 000	0,24	
GIVAUDAN SA-REG-S 0.150000% 20-10.11.28*	CHF		1 000 000		1 000 000	912 000	0,08	585 000
GIVAUDAN SA-REG-S 1.125000% 22-15.06.26*	CHF		1 750 000		1 750 000	1 750 648	0,14	
GIVAUDAN SA-REG-S 1.625000% 22-15.06.29*	CHF		2 220 000		2 220 000	2 215 693	0,18	
GRANDE DIXENCE SA 1.125000% 17-04.07.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 000 500	0,08	
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 0.300000% 21-31.08.28*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 200 750	0,26	
GS CALTEX CORP-REG-S 0.633000% 18-31.01.24*	CHF	3 500 000		3 500 000				
GZO AG SPITAL WETZIKON 1.875000% 14-12.06.24*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 533 750	0,21	280 000
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-REG-S 1.500000% 14-28.04.25*	CHF	450 000			450 000	455 175	0,04	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.000000% 15-01.07.21*	CHF	1 250 000		1 250 000				
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG 0.800000% 17-30.05.22*	CHF	2 500 000		2 500 000				
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.000000% 18-26.10.22*	CHF	250 000		250 000				
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 0.875000% 19-08.05.24*	CHF	200 000		200 000				
HILTI AG 0.400000% 17-08.11.27*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 041 700	0,09	
HILTI AG-REG-S 0.050000% 20-02.07.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 845 000	0,40	
HIRSlanden AG-REG-S 1.250000% 21-25.02.26*	CHF	2 100 000			2 100 000	2 034 900	0,17	175 000
IMPLENIA AG-REG-S 1.625000% 14-15.10.24*	CHF	5 515 000			5 515 000	5 404 700	0,45	3 045 000
IMPLENIA AG-REG-S 1.000000% 16-20.03.26*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 840 000	0,15	1 140 000
INVESTIS HOLDING SA 0.750000% 17-03.10.22*	CHF	3 250 000		3 250 000				
JULIUS BAER GROUP-REG-S 0.375000% 17-06.12.24*	CHF	300 000			300 000	294 600	0,02	
KANTONSSPITAL AARAU AG-REG-S 0.700000% 18-23.05.28*	CHF	820 000			820 000	788 840	0,07	5 000
KANTONSSPITAL AARAU AG-REG-S 1.100000% 18-23.05.33*	CHF	150 000			150 000	139 275	0,01	
KEB HANA BANK-REG-S 0.407500% 18-14.09.23*	CHF	250 000			250 000	249 525	0,02	
KERNKRAFTWERK GOESGEN-DAENIKEN-REG-S 0.930000% 20-30.09.27*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 330 250	0,28	
KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG-REG-S 1.500000% 18-07.08.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 020 000	0,42	150 000
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.750000% 11-09.06.23*	CHF	250 000			250 000	255 500	0,02	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 1.250000% 14-11.09.24*	CHF	200 000			200 000	200 700	0,02	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 0.500000% 15-09.09.21*	CHF	4 000 000		4 000 000				
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 1.500000% 16-06.12.22*	CHF	350 000			350 000	352 450	0,03	
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 0.700000% 17-30.01.26*	CHF	400 000			400 000	393 000	0,03	10 000
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 0.125000% 21-21.02.31*	CHF	565 000			565 000	488 443	0,04	
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.020000% 19-18.11.22*	CHF	2 700 000		2 700 000				
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.200000% 19-18.06.25*	CHF	580 000	3 060 000		3 640 000	3 541 720	0,29	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 2.000000% 13-09.06.22*	CHF	1 000 000		1 000 000				
LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 1.000000% 18-11.12.24*	CHF	6 150 000			5 900 000	5 870 500	0,49	
LGT BANK AG 0.200000% 16-12.10.26*	CHF	1 000 000			1 000 000			
LGT BANK AG 0.625000% 15-25.11.25*	CHF	2 900 000		2 900 000				
LIMECO-REG-S 0.375000% 18-25.09.26*	CHF	100 000			100 000	96 900	0,01	100 000
LINDT & SPRUENGLI AG 0.300000% 17-06.10.27*	CHF	400 000			400 000	381 200	0,03	400 000
LONZA SWISS FINANCE AG 1.250000% 15-22.09.23*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 109 350	0,09	
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.875000% 21-14.05.31*	CHF	3 200 000			3 200 000	2 912 000	0,24	
LUZERNER KANTONSSPITAL-REG-S 0.625000% 18-25.09.28*	CHF	620 000		620 000				
MOBIMO HOLDING AG 0.750000% 17-20.03.26*	CHF	200 000			200 000	194 900	0,02	
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.875000% 18-02.10.23*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 999 100	0,25	
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.250000% 20-23.03.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 740 500	0,23	
MONDELEZ INTL-REG-S 0.650000% 16-26.07.22*	CHF	2 000 000		2 000 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.250000% 20-18.09.28*	CHF	1 000 000	2 000 000		3 000 000	2 728 500	0,23	
NANT DE DRANCE SA 1.750000% 14-18.07.24*	CHF	250 000			250 000	254 000	0,02	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.250000% 20-25.06.27*	CHF	7 895 000		2 895 000	5 000 000	4 920 000	0,41	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 0.875000% 20-23.05.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	937 500	0,08	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.300000% 17-31.10.25*	CHF	2 000 000		2 000 000				
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.200000% 20-28.11.28*	CHF	3 000 000		3 000 000				
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.550000% 20-27.05.33*	CHF	200 000		200 000				
NOVARTIS AG 0.625000% 15-13.11.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 897 000	0,16	
NOVARTIS AG 1.050000% 15-11.05.35*	CHF	1 000 000			1 000 000	916 500	0,08	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.375000% 21-27.11.25*	CHF	4 755 000			4 755 000	4 472 078	0,37	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.800000% 21-27.11.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 783 000	0,15	
ORIOR AG 0.625000% 17-26.09.23*	CHF	3 105 000		3 105 000				
PANALPINA WELTTRANSPORT HLDG AG-REG-S 1.000000% 18-12.12.22*	CHF	50 000			50 000	50 260	0,00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG 0.150000% 17-07.06.24*	CHF	350 000			350 000	345 450	0,03	
PARTNERS GROUP HOLDING AG-REG-S 0.400000% 19-21.06.27*	CHF	2 860 000			2 860 000	2 721 290	0,23	
PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 1.750000% 18-04.12.23*	CHF	3 950 000			3 950 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.375000% 16-23.09.43*	CHF	100 000			100 000	76 630	0,01	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.125000% 19-10.12.30*	CHF	2 000 000		2 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.500000% 20-22.06.40*	CHF	1 000 000			1 000 000	811 000	0,07	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.375000% 22-20.09.29*	CHF		2 000 000	2 000 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.500000% 19-15.05.34*	CHF	500 000		500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.020000% 20-30.01.40*	CHF	500 000			500 000	372 750	0,03	500 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.200000% 20-22.05.42*	CHF	175 000			175 000	130 025	0,01	
PSP SWISS PROPERTY AG 1.000000% 15-06.02.25*	CHF	2 200 000		2 200 000				
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.500000% 16-16.02.24*	CHF	200 000			200 000	199 000	0,02	
PSP SWISS PROPERTY AG 0.375000% 16-29.04.26*	CHF	200 000			200 000	191 900	0,02	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.700000% 19-08.02.27*	CHF	3 950 000		3 950 000				
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.200000% 21-04.02.31*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 717 000	0,14	2 000 000
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 3.125000% 06-15.09.26*	CHF	1 000 000	1 950 000		2 950 000	3 181 575	0,26	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.750000% 16-22.04.31*	CHF	150 000			150 000	138 450	0,01	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.182500% 20-11.11.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.500000% 20-11.11.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	932 500	0,08	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 1.500000% 20-23.11.34*	CHF	2 800 000			2 800 000	2 532 600	0,21	
RIETER HOLDING AG-REG-S 1.550000% 20-17.09.24*	CHF	5 100 000			5 100 000	5 071 950	0,42	
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.100000% 17-23.09.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	990 500	0,08	
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.450000% 17-23.03.29*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 841 000	0,24	1 410 000
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.750000% 22-25.02.31*	CHF		6 000 000		6 000 000	5 649 000	0,47	
RZD CAPITAL PLC 2.100000% 17-02.10.23*	CHF	1 200 000	2 000 000	1 200 000	2 000 000	2 000 000	0,02	
SEE-SPITAL 1.250000% 18-03.07.26*	CHF	350 000			350 000	346 150	0,03	
SGS SA 0.875000% 15-08.05.30*	CHF	1 350 000			1 350 000	1 261 575	0,10	
SGS SA-REG-S 0.450000% 20-06.11.23*	CHF	1 535 000			1 535 000	1 531 470	0,13	200 000
SGS SA-REG-S 0.950000% 20-06.11.26*	CHF	860 000			860 000	845 810	0,07	
SIKA AG-REG-S 0.625000% 18-12.07.24*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 495 000	0,21	
SIX GROUP AG-REG-S 0.200000% 21-28.09.29*	CHF		4 515 000		4 515 000	4 081 560	0,34	650 000
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.750000% 20-06.10.28*	CHF	1 220 000	3 000 000		4 220 000	4 059 640	0,34	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.050000% 22-19.02.29*	CHF		1 660 000		1 660 000	1 621 820	0,13	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.400000% 22-19.02.32*	CHF		3 375 000		3 375 000	3 268 688	0,27	
SPAREBANK 1 SMN 0.350000% 16-05.04.23*	CHF	250 000		250 000				
SPITAL MAENNEDORF AG-REG-S 0.950000% 18-12.12.23*	CHF	500 000			500 000	495 250	0,04	
ST GALLER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.000000% 17-30.11.27*	CHF	150 000			150 000	143 700	0,01	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S 0.250000% 21-30.04.35*	CHF	2 000 000		2 000 000				
STADLER RAIL AG-REG-S 0.375000% 19-20.11.26*	CHF	4 770 000		250 000	4 520 000	4 264 620	0,35	

UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-03.10.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 964 000	0,16	
SULZER AG 0.37500% 16-11.07.22*	CHF	200 000	7 000 000	7 200 000	7 195 680	0,60	
SULZER AG 0.87500% 16-10.07.26*	CHF	200 000		200 000	187 500	0,02	
SULZER AG-REG-S 0.62500% 18-22.10.21*	CHF	6 800 000		6 800 000			
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF	4 200 000		4 200 000	4 187 400	0,35	
SULZER AG-REG-S 1.60000% 18-22.10.24*	CHF	3 200 000		3 200 000	3 169 600	0,26	
SWISS LIFE HOLDING AG 1.87500% 13-21.06.23*	CHF		2 000 000	2 000 000			
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.50000% 16-03.11.25*	CHF	250 000		250 000	243 625	0,02	135 000
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.82500% 17-11.05.26*	CHF	800 000		800 000	783 600	0,06	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24*	CHF	3 900 000		3 900 000	3 901 950	0,32	900 000
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 777 500	0,15	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 19-30.09.31*	CHF	2 200 000		2 200 000	1 877 700	0,16	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.65000% 20-18.12.29*	CHF	7 465 000		7 465 000	6 826 743	0,56	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 21-11.02.28*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 326 250	0,19	
SWISSCOM AG 0.12500% 16-15.09.32*	CHF	200 000		200 000	168 600	0,01	
SWISSCOM AG 0.13000% 20-18.09.31*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 578 500	0,21	
SWISSCOM AG 0.37500% 16-31.03.28*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 131 600	0,09	1 200 000
SWISSCOM AG 0.37500% 17-31.05.27*	CHF	200 000	4 250 000	4 450 000	4 245 300	0,35	
SWISSCOM AG 1.00000% 15-17.04.35*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 784 000	0,15	
SWISSCOM AG-REG-S 0.75000% 17-24.11.33*	CHF	1 000 000		1 000 000	878 500	0,07	
SWISSCOM AG-REG-S 0.50000% 19-15.03.29*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 404 750	0,12	
SWISSCOM AG-REG-S 0.75000% 18-12.10.28*	CHF	600 000	1 000 000	1 600 000	1 533 600	0,13	
SWISSCOM AG-REG-S 0.25000% 21-18.05.33*	CHF	785 000		785 000	659 400	0,05	
SWISSCOM AG-REG-S 1.50000% 14-28.09.29*	CHF	100 000		100 000	99 850	0,01	
SWISSGRID AG-REG-S 0.20000% 20-30.06.32*	CHF	500 000		500 000	426 750	0,04	
SWISSGRID AG-REG-S 0.12500% 20-30.06.36*	CHF	2 250 000		1 250 000	1 000 000	0,06	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.12500% 20-09.12.22*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 494 000	0,21	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.70000% 20-09.12.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 868 000	0,15	1 315 000
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23*	CHF	2 350 000		2 350 000	2 340 130	0,19	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24*	CHF		6 000 000	6 000 000	5 847 000	0,48	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 19-03.12.21*	CHF	535 000		535 000			
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 0.60000% 20-07.11.22*	CHF	4 815 000	3 500 000	7 715 000	7 668 710	0,63	
TEMENOS AG-REG-S 1.50000% 19-28.11.25*	CHF	2 300 000		2 300 000	2 219 500	0,18	1 350 000
TEMENOS AG-REG-S 1.87500% 18-30.11.23*	CHF	800 000		800 000	799 120	0,07	765 000
TEMENOS GROUP AG 2.00000% 15-17.06.22*	CHF	250 000	2 000 000	2 250 000	2 249 550	0,19	200 000
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22*	CHF	500 000		500 000	497 050	0,04	
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.00000% 16-28.07.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	895 500	0,07	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.16600% 19-21.12.29*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 659 500	0,22	
TRANSPower NEW ZEALAND LTD 0.02000% 19-16.12.27*	CHF	2 500 000		450 000	2 050 000	0,16	
UBS GROUP AG 0.37500% 21-24.08.29*	CHF	4 800 000		4 800 000	4 288 800	0,35	400 000
UBS GROUP AG-REG-S 0.62500% 17-18.05.24*	CHF	200 000		200 000			
UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26*	CHF	2 200 000	2 000 000	4 200 000	4 189 500	0,35	2 800 000
UNION BANCAIRE PRIVÉE UBP SA 0.20000% 21-15.12.26*	CHF		4 150 000	4 150 000	3 921 750	0,32	480 000
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.55500% 21-24.03.31*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 303 500	0,11	
VIFOR PHARMA AG-REG-S 0.75000% 18-13.09.22*	CHF	1 290 000		1 290 000	1 291 161	0,11	
VP BANK AG-REG-S 0.60000% 19-29.11.29*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 248 100	0,10	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.05000% 16-23.11.26*	CHF	2 900 000		2 900 000	2 775 300	0,23	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 20-05.02.31*	CHF	4 200 000		4 200 000	3 712 800	0,31	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.20000% 22-31.07.30*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 713 500	0,22	850 000
ZUG ESTATES HOLDING AG 0.70000% 17-17.02.22*	CHF	50 000		50 000			
ZUG ESTATES HOLDING AG-REG-S 0.10000% 19-02.10.25*	CHF	200 000		200 000	191 600	0,02	20 000
ZUGER KANTONALBANK 0.12500% 19-03.12.29*	CHF	2 750 000		2 750 000			
ZURICH INSURANCE CO-REG-S 1.00000% 18-30.10.28*	CHF	480 000		480 000	464 880	0,04	405 000
Total CHF					402 556 891	33,31	

Total Anleihen, fester Zins **402 556 891** **33,31**

Anleihen, Nullcoupon

CHF							
AMAG LEASING AG-REG-S 0.00000% 21-18.02.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 461 000	0,12	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-23.09.22*	CHF	200 000		200 000			
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-25.09.26*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 131 000	0,09	1 000 000
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-06.09.28*	CHF	500 000		500 000			
KOREA GAS CORP-REG-S 0.00000% 19-28.11.23*	CHF	1 750 000		1 750 000			
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.00000% 19-04.10.24*	CHF	600 000		600 000			
KOREA RAILROAD CORP-REG-S 0.00000% 19-13.06.25*	CHF	520 000		520 000			
LIECHTENSTEINISCHE LANDESBANK AG-REG-S 0.00000% 19-27.09.29*	CHF	150 000		150 000	131 325	0,01	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-07.08.28*	CHF	1 500 000		1 500 000			
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 20-02.04.31*	CHF	600 000		600 000			
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.00000% 19-06.02.30*	CHF	1 850 000		1 850 000	1 601 175	0,13	525 000
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-11.10.29*	CHF	50 000		50 000	44 500	0,00	
SWISSCOM AG-REG-S 0.00000% 19-30.08.44*	CHF	1 150 000		1 150 000	727 375	0,06	
SWISSGRID AG-REG-S 0.00000% 20-30.06.28*	CHF	3 000 000		2 000 000	1 919 500	0,08	
Total CHF					6 015 875	0,50	

Total Anleihen, Nullcoupon **6 015 875** **0,50**

Anleihen, variabler Zins

CHF							
BALOISE LIFE LTD-SUB 1.750%/VAR 17-PRP*	CHF	145 000		145 000	143 913	0,01	
BANK CLER AG-SUB 3.000%/VAR 20-PRP*	CHF	2 750 000		2 750 000	2 572 625	0,21	
BASLER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.875%/VAR PRP*	CHF	2 175 000		2 175 000	2 078 213	0,17	500 000
GLARNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 943 000	0,16	1 000 000
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF	2 830 000	1 500 000	4 330 000	4 124 325	0,34	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERU-REG-S-SUB 1.450%/VAR 20-12.08.40*	CHF	875 000		875 000	767 813	0,06	335 000
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FIN-REG-S-SUB 3.500%/VAR 18-PRP*	CHF	2 900 000	1 800 000	4 700 000	4 768 150	0,39	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF	2 665 000		2 665 000	2 406 495	0,20	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-PRP*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 903 000	0,16	340 000
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF	1 685 000	1 000 000	2 685 000	2 647 410	0,22	
ZUERCHER KANTONALBANK-SUB 2.125%/VAR 17-PRP*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 964 000	0,16	
ZURICH INSURANCE CO-SUB 2.750%/VAR 14-PRP*	CHF		2 000 000	2 000 000			
ZURICH INSURANCE CO-REG-S-SUB 2.750%/VAR 16-PRP*	CHF	400 000		400 000			
Total CHF					25 318 943	2,09	

Total Anleihen, variabler Zins **25 318 943** **2,09**

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Wandelanleihen, variabler Zins

CHF

CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB COCO 3.000%/VAR 19-PRP*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 170 350	0,18	630 000
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 1.800%/VAR 19-PRP*	CHF	1 000 000		1 000 000	943 000	0,08	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S-SUB 3.125%/VAR 19-PRP*	CHF	1 000 000		1 000 000	927 580	0,08	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB COCO 1.700%/VAR 17-PRP*	CHF	1 000 000		1 000 000	978 986	0,08	
Total CHF					5 019 916	0,42	

Total Wandelanleihen, variabler Zins

5 019 916 0,42

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

1 175 918 417 97,30

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

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF

TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.000000% 21-16.08.23**	CHF	5 000 000		5 000 000	4 877 400	0,40	
Total CHF					4 877 400	0,40	

Total Medium-Term Notes, fester Zins

4 877 400 0,40

Anleihen, fester Zins

CHF

UBS AG/LONDON 0.710000% 22-13.04.25**	CHF	2 000 000		2 000 000	1 979 780	0,15	
Total CHF					1 979 780	0,15	

Total Anleihen, fester Zins

1 979 780 0,15

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

6 857 180 0,56

Total Wertschriften

(davon ausgeliehen) 1 182 775 597 97,86
82 634 311 6,84

Bankguthaben auf Sicht					19 713 212	1,63	
Derivative Finanzinstrumente					807 029	0,07	
Sonstige Vermögenswerte					5 261 710	0,44	
Gesamtfondsvermögen					1 208 557 548	100,00	

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-14 963 126		
Andere Verbindlichkeiten					-176 082		
Nettofondsvermögen					1 193 418 340		

Bewertungskategorie

	Verkehrswert per 31.5.2022	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 175 918 417	97,30
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	7 664 209	0,63
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	1 183 582 626	97,93

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.225000% 22-17.05.32**	27 000 000	CHF	27 000 000	388 454	0.03
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-17.05.32	27 000 000	CHF			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 0.740000% 22-18.05.27**	50 000 000	CHF	50 000 000	418 575	0.04
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-18.05.27	50 000 000	CHF			
			77 000 000	807 029	0.07

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-17.05.32	CHF	27 000 000	27 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.225000% 22-17.05.32	CHF	27 000 000	27 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-18.05.27	CHF	50 000 000	50 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 0.740000% 22-18.05.27	CHF	50 000 000	50 000 000

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	82 933 410,09	6,95%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	–	–
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

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

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse F: 0,18%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 3% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 3% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 1.026847

USD 1 = CHF 0.958550

UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable

Art Effektenfonds

Dreijahresvergleich

	ISIN	31.5.2022	31.5.2021	31.5.2020
Nettofondsvermögen in CHF		2 162 868 926.93	1 988 305 930.65	258 885 717.20
Klasse I-X	CH0540307235		¹	
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		90.55	99.84	
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		90.42	99.74	
Anzahl Anteile im Umlauf		455 530,3340	441 179,8520	
Klasse P	CH0002791843			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		111.30	122.73	123.08
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		111.14	122.61	122.80
Anzahl Anteile im Umlauf		603 899,4470	676 737,7650	759 109,4450
Klasse Q	CH0203279580			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		89.87	98.99	98.88
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		89.74	98.89	98.65
Anzahl Anteile im Umlauf		34 622,5940	38 788,0840	38 285,3060
Klasse U-X	CH0111018120			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		9 281.98	10 214.83	10 173.12
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		9 268.99	10 204.62	10 149.72
Anzahl Anteile im Umlauf		220 998,0000	181 830,0250	15 891,5070

¹ Erstemission per 30.6.2020
² siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2021/2022	2020/2021	2019/2020
Klasse I-X ¹	CHF	-8.5%	-	-
Klasse P ¹	CHF	-9.4%	-0.2%	- ²
Klasse Q ¹	CHF	-9.0%	0.2%	- ²
Klasse U-X ¹	CHF	-8.5%	0.8%	- ²

¹ Der Fonds verfügt (gemäss Fondsvertrag) über keine Benchmark, daher erfolgt kein Vergleich der Fondsperformance mit einer Benchmark.
² Aufgrund eines Strategiewechsels am 26. März 2020 wird auf den Ausweis der Jahresperformance verzichtet.

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

Bericht des Portfoliomanagers

Die Zinssätze am Schweizer Kapitalmarkt stiegen im Rechnungsjahr vom 1. Juni 2021 bis zum 31. Mai 2022 über alle Laufzeiten an, wobei die Swapkurve etwas steiler wurde. Die fünfjährigen Swapsätze zogen um 1,39% an. Damit liessen sie den negativen Bereich hinter sich und schlossen bei +0,94%. Die zehnjährigen Renditen kletterten um 1,45% auf +1,41%. Die Kreditrisikoprämien (Spreads) von Unternehmensanleihen gegenüber den Swapsätzen weiteten sich im Februar 2022 infolge der russischen Invasion in der Ukraine massiv aus, erholten sich aber in den folgenden Wochen wieder. Während des Berichtszeitraums blieben die Spreads unverändert bei 35 Basispunkten. Die Schweizerische Nationalbank (SNB) setzte ihre expansive Geldpolitik fort. Sie belies den Leitzins bei -0,75% und belastete Sichteinlagen von Banken weiter mit einem Negativzins von -0,75%. Im Jahr 2021 setzte die SNB ihre Interventionen am Devisenmarkt fort, wobei sie insgesamt Devisen für CHF 21,1 Milliarden kaufte.

Der Subfonds wies eine negative Performance aus, hauptsächlich wegen der nachteiligen Preiseffekte aufgrund der höheren Zinssätze. Die Duration wurde im Vergleich

zum Anlageuniversum eher kurz, bei durchschnittlich sieben Jahren gehalten. Die Sektorpositionierung, mit einer Übergewichtung in Unternehmensanleihen gegenüber einer Untergewichtung in Pfandbriefen und Schweizer Staatsanleihen, war neutral, während sich die Titelauswahl mit einer Untergewichtung in Anleihen von russischen Emittenten vorteilhaft auswirkte.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	65,97
Frankreich	4,03
Kanada	3,91
Deutschland	3,62
Vereinigte Staaten	3,30
Australien	2,73
Grossbritannien	2,70
Supranational	2,10
Spanien	1,58
Vereinigte Arabische Emirate	1,31
Übrige	7,12
Total	98,37

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	31.5.2022	31.5.2021
Verkehrswerte	CHF	CHF
Bankguthaben		
– auf Sicht	24 559 362.55	13 214 712.10
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2 139 710 699.55	1 977 129 428.42
Derivative Finanzinstrumente	1 412 890.40	0.00
Sonstige Vermögenswerte	9 554 130.55	9 992 364.77
Gesamtfondsvermögen	2 175 237 083.05	2 000 336 505.29
Aufgenommene Kredite	-12 316 587.04	-11 999 076.79
Andere Verbindlichkeiten	-51 569.08	-31 497.85
Nettofondsvermögen	2 162 868 926.93	1 988 305 930.65

Erfolgsrechnung

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
Ertrag	CHF	CHF
Erträge der Bankguthaben	675.89	0.00
Negativzinsen	-140 415.95	-139 112.35
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	12 908 580.00	12 419 685.22
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	577 790.31	627 985.39
Erträge der Effektenleihe	128 898.13	104 385.55
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	1 876 320.42	1 392 243.90
Total Ertrag	15 351 848.80	14 405 187.71
Aufwand		
Passivzinsen	-282.08	0.00
Prüfaufwand	-14 146.40	-14 146.40
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X	0.00	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P	-693 030.31	-789 429.32
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q	-20 927.19	-18 484.16
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse U-X	0.00	0.00
Sonstige Aufwendungen	-1 849.47	-2 010.32
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-30 646.97	-41 005.58
Total Aufwand	-760 882.42	-865 075.78
Nettoertrag	14 590 966.38	13 540 111.93
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	2 846 532.61	4 281 469.18
Realisierter Erfolg	17 437 498.99	17 821 581.11
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-201 308 273.98	-5 929 989.18
Gesamterfolg	-183 870 774.99	11 891 591.93

Verwendung des Erfolges

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	14 590 966.38	13 540 111.93
Übertrag auf das Kapital ²	176 578.77	152 666.47
Vortrag des Vorjahres	2 216.36	3 413.08
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	14 769 761.51	13 696 191.48
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-14 763 261.88	-13 693 975.12
Vortrag auf neue Rechnung	6 499.63	2 216.36

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

² Umbuchung Nettoverlust Klasse D1, gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.9.4 in Verbindung mit Art. 29 VStV.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 988 305 930.65	258 885 717.20
Ordentliche Jahresausschüttung	-13 675 451.44	-3 708 523.98
Saldo aus dem Anteilverkehr	372 109 222.71	1 721 237 145.50
Gesamterfolg	-183 870 774.99	11 891 591.93
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	2 162 868 926.93	1 988 305 930.65

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	441 179,8520	0,0000
Ausgegebene Anteile	38 782,7400	441 179,8520
Zurückgenommene Anteile	-24 432,2580	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	455 530,3340	441 179,8520
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	14 350,4820	441 179,8520
Klasse P		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	676 737,7650	759 109,4450
Ausgegebene Anteile	9 374,9470	20 243,1430
Zurückgenommene Anteile	-82 213,2650	-102 614,8230
Bestand Ende Berichtsperiode	603 899,4470	676 737,7650
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-72 838,3180	-82 371,6800
Klasse Q		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	38 788,0840	38 285,3060
Ausgegebene Anteile	17 286,8970	9 262,6490
Zurückgenommene Anteile	-21 452,3870	-8 759,8710
Bestand Ende Berichtsperiode	34 622,5940	38 788,0840
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-4 165,4900	502,7780
Klasse U-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	181 830,0250	15 891,5070
Ausgegebene Anteile	40 452,9750	167 432,5220
Zurückgenommene Anteile	-1 285,0000	-1 494,0040
Bestand Ende Berichtsperiode	220 998,0000	181 830,0250
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	39 167,9750	165 938,5180

Ausschüttung für 2021/2022

Klasse I-X

(Gegen Coupon Nr. 2- Ex-Datum 10.8.2022)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	0.64116
Brutto	CHF	0.64000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.22400
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.41600

Klasse P

Für das abgeschlossene Geschäftsjahr erfolgt keine Ausschüttung.

Klasse Q

(Gegen Coupon Nr. 2- Ex-Datum 10.8.2022)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	0.15327
Brutto	CHF	0.15000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.05250
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.09750

Klasse U-X

(Gegen Coupon Nr. 13- Ex-Datum 10.8.2022)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	65.466
Brutto	CHF	65.460
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-22.911
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	42.549

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
SWISS AUTO LEASE GMBH-REG-S 0.15000% 19-23.03.28*	CHF	400 000	400 000				
SWISS AUTO LEASE GMBH-REG-S STEP-UP 20-23.03.30*	CHF	100 000		100 000	98 299	0,00	
SWISS CAR ABS 2020-1 AG-REG-S 0.62500% 20-18.08.30*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 497 579	0,07	
SWISS CAR ABS-REG-S 0.22000% 18-18.10.28*	CHF	500 000	500 000				
SWISS CAR ABS-REG-S 0.50000% 21-18.04.31*	CHF	2 330 000		2 330 000	2 308 972	0,11	
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 0.10000% 18-15.06.23*	CHF	250 000	250 000				
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE 2019-REG-S 0.04000% 19-15.06.24*	CHF	575 000		575 000	574 978	0,03	
SWISSCARD AECS GMBH-REG-S 0.35000% 21-15.06.26*	CHF		2 530 000	2 530 000	2 483 838	0,11	
Total CHF					6 963 665	0,32	
Total Asset Backed Securities, fester Zins					6 963 665	0,32	
Asset-Backed-Securities, Nullcoupon							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S 0.00000% 19-16.12.28*	CHF	135 000		135 000	134 851	0,01	
Total CHF					134 851	0,01	
Total Asset-Backed-Securities, Nullcoupon					134 851	0,01	
Asset Backed Securities, variabler Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S STEP-UP 20-15.02.29*	CHF	2 460 000		2 460 000	2 454 746	0,11	
Total CHF					2 454 746	0,11	
Total Asset Backed Securities, variabler Zins					2 454 746	0,11	
Notes, fester Zins							
CHF							
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.87500% 15-23.01.30*	CHF	2 950 000		2 950 000	2 840 850	0,13	205 000
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.95000% 21-25.03.31*	CHF	1 165 000		1 165 000	1 039 180	0,05	
AKEB AG FUER KERNENERGIE BETELIG-REG-S 1.45000% 20-23.07.27*	CHF	3 885 000		3 885 000	3 844 208	0,18	
AT&T INC-REG-S 1.37500% 14-04.12.24*	CHF	740 000	740 000				
AXPO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 22-04.02.25*	CHF		3 500 000	3 500 000	3 417 750	0,16	
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF 1.50000% 13-26.06.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 070 500	0,14	190 000
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.25000% 20-02.09.32*	CHF	900 000		900 000	785 250	0,04	
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.85000% 22-21.01.32*	CHF		5 300 000	5 300 000	4 717 000	0,22	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 2.37500% 12-05.03.24*	CHF	400 000	400 000				
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.18000% 21-20.04.29*	CHF		15 650 000	15 650 000	13 685 925	0,63	225 000
EBN BV-REG-S 0.87500% 14-22.09.26*	CHF	170 000		170 000	168 980	0,01	
ENERGIEFINANZIERUNGS AG 2.62500% 11-31.01.23*	CHF	250 000		250 000	253 250	0,01	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 14-04.02.25*	CHF	575 000	575 000				
GENEVA, CANTON OF 1.62500% 14-30.07.29*	CHF	800 000		800 000	825 200	0,04	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.00000% 21-28.07.31*	CHF		2 180 000	2 180 000	2 082 990	0,10	
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.05000% 19-09.10.23*	CHF	2 615 000	615 000	2 000 000	1 975 000	0,09	
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.25000% 21-14.02.25*	CHF	3 200 000		3 200 000	3 104 000	0,14	
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF		3 850 000	3 850 000	3 742 200	0,17	1 900 000
KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY JSC 3.63800% 14-20.06.22*	CHF	1 350 000	1 350 000				
LGT BANK AG 1.87500% 13-08.02.23*	CHF	1 715 000	1 715 000				
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF	4 280 000		4 280 000	4 115 220	0,19	1 300 000
LUZERNER KANTONALBANK 1.25000% 11-04.10.41*	CHF	500 000		500 000	527 000	0,02	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	957 000	0,04	295 000
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF-REG-S 0.12500% 19-06.12.32*	CHF	200 000		200 000	171 100	0,01	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25000% 15-30.04.25*	CHF	3 000 000	1 000 000	2 000 000	1 957 000	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 12-14.02.24*	CHF	3 000 000		3 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 12-14.02.40*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 933 400	0,09	2 000 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 12-20.09.29*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 016 000	0,09	200 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-21.01.30*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 802 300	0,13	600 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 15-05.05.28*	CHF	4 500 000		4 500 000	4 339 500	0,20	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 19-15.04.30*	CHF	12 065 000		12 065 000	11 117 898	0,51	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 19-26.04.34*	CHF	850 000		850 000	726 750	0,03	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-13.08.27*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 386 250	0,11	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 20-15.03.41*	CHF	15 000 000		15 000 000	11 535 000	0,53	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-17.08.40*	CHF	12 090 000		12 090 000	9 077 172	0,42	6 900 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST-REG-S 0.12500% 20-14.10.33*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 553 000	0,12	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 21-24.01.41*	CHF	3 300 000		3 300 000	2 526 150	0,12	2 405 000
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.55000% 19-04.02.28*	CHF	2 250 000	250 000	2 000 000	1 895 000	0,09	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.15000% 20-02.02.29*	CHF	500 000		500 000	449 500	0,02	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-SUB 4.75000% 12-24.10.22*	CHF	360 000		360 000	362 304	0,02	
ROCHE CAPITALMARKT AG-REG-S 0.50000% 22-25.02.27*	CHF		4 000 000	4 000 000	3 898 000	0,18	
RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS-REG-S 1.19500% 19-03.04.28*	CHF	50 000		50 000	4 000	0,00	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.50000% 20-06.10.25*	CHF	7 645 000		7 645 000	7 537 970	0,35	400 000
SULZER AG 0.87500% 20-18.11.27*	CHF	5 500 000	1 925 000	7 425 000	6 797 588	0,31	1 425 000
SULZER AG-REG-S 0.80000% 20-23.09.25*	CHF	5 210 000		5 210 000	4 970 340	0,23	220 000
SWISSCOM AG 1.75000% 12-10.07.24*	CHF	2 480 000		2 480 000	2 533 320	0,12	
TECAN GROUP AG-REG-S 0.05000% 21-06.10.25*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 872 500	0,13	250 000
TRANSPower NEW ZEALAND LTD 0.03750% 21-16.03.29*	CHF	2 000 000	1 000 000	3 000 000	2 733 000	0,13	
UBS GROUP AG-REG-S 0.43500% 21-09.11.28*	CHF	14 800 000		14 800 000	13 542 000	0,62	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.19250% 21-24.03.28*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 098 600	0,05	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 21-21.10.31*	CHF	7 500 000		7 500 000	6 615 000	0,30	
Total CHF					159 601 993	7,34	
Total Notes, fester Zins					159 601 993	7,34	
Notes, Nullcoupon							
CHF							
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.07.25*	CHF	500 000	500 000				
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.10.30*	CHF		5 000 000	5 000 000	4 402 500	0,20	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.00000% 21-25.11.22*	CHF	10 500 000		4 500 000	4 492 350	0,21	
RHAETISCHE BAHN STAMM 0.00000% 21-29.09.36*	CHF		2 000 000	2 000 000	1 560 000	0,07	2 000 000
Total CHF					10 454 850	0,48	
Total Notes, Nullcoupon					10 454 850	0,48	

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Notes, variabler Zins							
CHF							
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-30.09.41*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 600 000	0,17	1 690 000
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 1.500%/VAR 22-03.05.52*	CHF		12 000 000	12 000 000	10 320 000	0,47	320 000
Total CHF					13 920 000	0,64	
Total Notes, variabler Zins					13 920 000	0,64	
Medium-Term Notes, fester Zins							
CHF							
ABN AMRO BANK NV 0.50000% 15-29.07.22*	CHF	1 670 000					
ACHMEA BANK NV 0.50000% 17-27.10.23*	CHF	2 250 000		2 250 000	2 245 950	0,10	
ACHMEA BANK NV 0.50000% 17-03.10.25*	CHF	200 000		200 000	195 400	0,01	10 000
ACHMEA BANK NV-REG-S 0.50000% 18-15.11.22*	CHF	2 000 000	2 000 000				
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.37500% 18-23.01.23*	CHF	1 700 000	1 700 000				
ADCB FINANCE CAYMAN LTD 0.72500% 18-15.02.24*	CHF	1 290 000		1 290 000	1 283 550	0,06	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24*	CHF	1 655 000		1 655 000	1 619 418	0,07	
ADECCO SA 0.87500% 20-27.11.25*	CHF	8 000 000		8 000 000	7 956 000	0,37	
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23*	CHF	600 000	600 000				
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 2.62500% 10-18.02.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 054 000	0,05	
AKADEMISKA HUS AB 0.25000% 15-17.11.25*	CHF	990 000		990 000	971 685	0,04	
AKADEMISKA HUS AB 0.30000% 17-08.10.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	933 000	0,04	
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.65000% 18-08.02.44*	CHF	180 000		180 000	142 380	0,01	
ALBERTA, PROVINCE OF-REG-S 0.37500% 19-07.02.29*	CHF	1 000 000	500 000	500 000	471 750	0,02	500 000
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.75000% 18-19.12.22*	CHF	565 000		565 000	557 938	0,03	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN 0.25000% 16-25.10.23*	CHF	2 870 000		2 870 000	2 855 937	0,13	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF	955 000		955 000	939 720	0,04	
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF	450 000	450 000				
ASB FINANCE LTD 0.20000% 17-02.08.24*	CHF	840 000		840 000	823 620	0,04	
ASB FINANCE LTD-REG-S 0.11750% 21-29.06.28*	CHF		5 000 000	5 000 000	4 490 000	0,21	125 000
ASB FINANCE LTD/LONDON-REG-S 0.45000% 19-30.01.25*	CHF	3 000 000	1 000 000	4 000 000	3 920 000	0,18	25 000
ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.85000% 20-14.10.25*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 888 000	0,18	
ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.50000% 21-15.01.27*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 495 200	0,07	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24*	CHF	1 245 000		1 245 000	1 221 345	0,06	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.25000% 19-24.09.29*	CHF	500 000	500 000				
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF	1 460 000	460 000	1 000 000	933 500	0,04	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF		1 760 000	1 760 000	1 661 440	0,08	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE 0.57500% 17-07.04.27*	CHF	225 000	225 000				
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24*	CHF	530 000	530 000				
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.24000% 19-06.06.25*	CHF	960 000	960 000				
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.44100% 18-21.12.23*	CHF	455 000	455 000				
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24*	CHF	495 000	495 000				
BANCO SANTANDER SA 0.75000% 17-12.06.23*	CHF	1 175 000	300 000	875 000	876 925	0,04	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24*	CHF	550 000	2 000 000	2 550 000	2 525 775	0,12	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF	1 860 000		1 860 000	1 793 040	0,08	
BANK OF MONTREAL-REG-S 0.05000% 18-30.12.22*	CHF	3 320 000	3 320 000				
BANK OF NEW ZEALAND 0.362500% 21-14.12.29*	CHF		2 000 000	1 400 000	1 245 300	0,06	
BANK OF NOVA SCOTIA DN-REG-S 0.14250% 21-25.10.28*	CHF	8 300 000		8 300 000	7 474 150	0,34	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.38500% 22-01.02.29*	CHF		3 500 000	3 500 000	3 181 500	0,15	575 000
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.20000% 18-19.11.25*	CHF	625 000	500 000	125 000	122 313	0,01	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.30250% 21-30.07.31*	CHF		4 300 000	4 300 000	3 637 800	0,17	190 000
BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.30000% 15-16.09.22*	CHF	1 900 000	1 900 000				
BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.27800% 22-01.04.27*	CHF		6 000 000	6 000 000	5 802 000	0,27	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.40000% 19-12.02.24*	CHF		150 000	150 000	149 025	0,01	
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S 1.00000% 19-10.07.25*	CHF	600 000		600 000	586 500	0,03	
BARCLAYS PLC 0.31500% 21-04.06.27*	CHF	5 000 000	2 000 000	7 000 000	6 489 000	0,30	
BARCLAYS PLC-REG-S 1.12500% 18-12.07.23*	CHF	2 200 000		2 200 000	2 212 760	0,10	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.37500% 18-23.03.26*	CHF	380 000		380 000	372 210	0,02	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK-REG-S 0.37500% 19-13.05.30*	CHF	11 500 000		11 500 000	10 597 250	0,49	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.05000% 20-28.01.31*	CHF	6 000 000	5 000 000	11 000 000	9 724 000	0,45	
BERLIN HYP AG 0.25000% 20-11.09.28*	CHF	4 500 000	200 000	4 300 000	3 938 800	0,18	
BERLIN HYP AG 0.25000% 21-04.10.29*	CHF		11 400 000	11 400 000	10 185 900	0,47	700 000
BERLIN-HANNOVERSCHE HYPOTHEKENBANK-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	2 350 000	8 850 000	400 000	10 800 000	9 331 200	0,43
BKW AG-REG-S 0.25000% 19-29.07.27*	CHF		150 000	150 000	142 050	0,01	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24*	CHF	915 000		915 000	905 850	0,04	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.75000% 19-03.09.27*	CHF	170 000		170 000	165 410	0,01	
BNP PARIBAS 1.87500% 12-12.09.22*	CHF	2 170 000	2 170 000				
BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28*	CHF		4 400 000	4 400 000	4 111 800	0,19	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.30000% 19-15.10.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 823 000	0,08	2 000 000
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.15000% 20-10.03.28*	CHF	3 600 000	4 600 000	8 200 000	7 507 100	0,35	
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.14750% 21-13.07.27*	CHF		5 000 000	5 000 000	4 670 000	0,21	400 000
BNP PARIBAS-REG-S 0.50000% 21-16.03.29*	CHF	5 400 000	1 000 000	6 400 000	5 804 800	0,27	
BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25*	CHF	1 750 000		1 750 000	1 732 500	0,08	
BNP PARIBAS-SUB 1.75000% 15-05.06.25*	CHF	1 105 000		1 105 000	1 108 868	0,05	535 000
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.11100% 20-24.07.28*	CHF	3 000 000	500 000	2 500 000	2 263 750	0,10	
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 970 000	0,09	95 000
BPCE SA-REG-S 0.50000% 19-08.11.23*	CHF	1 090 000		1 090 000	1 086 839	0,05	
CAIXABANK SA-REG-S 0.47700% 21-01.07.27*	CHF		4 200 000	4 200 000	3 916 500	0,18	200 000
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE/CAD 0.12500% 15-22.12.25*	CHF	1 470 000		1 470 000	1 433 250	0,07	
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.15000% 18-31.07.23*	CHF	1 590 000	1 590 000				
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.05000% 19-15.10.26*	CHF	1 975 000	1 000 000	975 000	912 113	0,04	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.10000% 18-30.04.25*	CHF	510 000		510 000	500 820	0,02	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.60000% 19-30.01.25*	CHF	905 000	400 000	1 305 000	1 281 510	0,06	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.28250% 22-03.02.27*	CHF		1 800 000	1 800 000	1 689 300	0,08	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.96750% 22-26.04.29*	CHF		7 500 000	800 000	6 700 000	6 579 400	0,30
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF	870 000		870 000	864 258	0,04	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24*	CHF	6 700 000	1 000 000	5 700 000	5 597 400	0,26	175 000
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF	5 300 000		5 300 000	5 194 000	0,24	
CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26*	CHF		4 000 000	4 000 000	3 770 000	0,17	715 000
CELLNEX TELECOM SA 1.11750% 20-17.07.25*	CHF	3 025 000	225 000	3 250 000	3 146 000	0,14	1 195 000
CELLNEX TELECOM SA-REG-S 0.77500% 20-18.02.27*	CHF	2 440 000	1 200 000	3 640 000	3 294 200	0,15	460 000
CENTRAL AMERICAN BANK ECO INTEGRAT 0.17000% 21-29.09.31*	CHF		4 000 000	2 000 000	2 000 000		
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 0.37100% 16-26.08.22*	CHF	4 150 000		4 150 000			
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.20000% 19-25.03.24*	CHF	4 250 000	2 000 000	2 250 000	2 227 500	0,10	
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.40500% 20-25.06.25*	CHF	750 000	750 000				
CIE DE FINANCIAMIENTO FONCIER SA-REG-S 0.89000% 22-27.04.29*	CHF		5 000 000	5 000 000	4 890 000	0,22	
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26*	CHF	1 690 000	690 000	1 000 000	970 000	0,04	
CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 19-01.11.28*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 743 500	0,13	
CITIGROUP INC-REG-S 0.25000% 21-30.08.29*	CHF		11 150 000	11 150 000	9 767 400	0,45	
COMMERZBANK AG-REG-S 1.10000% 18-11.07.25*	CHF	7 400 000		7 400 000	7 192 800	0,33	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.40000% 17-25.09.26*	CHF	940 000		940 000	902 870	0,04	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.18750% 21-08.12.28*	CHF		2 500 000	2 500 000	2 282 500	0,10	

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.15750% 21-08.12.31*	CHF	4 100 000	1 100 000	3 000 000	2 641 500	0,12	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.00000% 14-05.02.24*	CHF	1 315 000		1 315 000	1 343 930	0,06	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.50000% 14-01.12.28*	CHF	5 040 000		5 040 000	4 974 480	0,23	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.50000% 15-26.02.26*	CHF	4 505 000	1 000 000	3 505 000	3 413 870	0,16	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.15000% 16-24.02.22*	CHF	1 400 000	1 400 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.30400% 16-16.09.24*	CHF	65 000		65 000	64 058	0,00	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 468 750	0,11	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	2 440 000		2 440 000	2 460 496	0,11	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.25000% 15-18.06.26*	CHF	1 340 000		1 340 000	1 304 490	0,06	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 18-08.12.25*	CHF	340 000		340 000	333 200	0,02	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.50000% 18-03.10.28*	CHF	1 215 000		1 215 000	1 162 147	0,05	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 19-24.10.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 850 000	0,09	
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.03000% 21-24.09.31*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 602 500	0,12	
CREDIT AGRICOLE SA 0.21250% 21-21.06.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 770 000	0,08	40 000
CREDIT AGRICOLE SA 0.41000% 22-18.01.30*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 056 600	0,05	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 2.12500% 14-30.10.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 028 000	0,05	1 000 000
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 15-15.09.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 000 600	0,05	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	60 000		60 000	59 430	0,00	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 19-07.11.25*	CHF	2 800 000	200 000	2 400 000	2 358 000	0,11	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.12750% 20-27.07.28*	CHF	2 835 000	895 000	3 730 000	3 340 215	0,15	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF	2 400 000	2 000 000	800 000	3 600 000	3 407 400	0,16
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.25000% 21-10.03.31*	CHF	2 700 000		400 000	2 300 000	1 951 550	0,09
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 0.16370% 21-28.04.28*	CHF	1 000 000	500 000	500 000	455 250	0,02	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-SUB 2.12500% 15-29.09.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 017 000	0,05	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 17-12.07.24*	CHF	500 000	1 000 000	1 500 000	1 483 500	0,07	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S-SUB 0.25000% 19-10.10.29*	CHF	3 320 000		3 320 000	2 908 320	0,13	
CREDIT SUISSE GROUP AG 1.00000% 15-14.04.23*	CHF		4 000 000	4 000 000	4 002 800	0,18	
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.25000% 18-14.11.22*	CHF	170 000		170 000			
DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.50000% 12-21.02.24*	CHF	50 000		50 000	50 875	0,00	50 000
DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.50000% 14-26.08.24*	CHF	100 000		100 000	102 000	0,00	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.45000% 17-08.11.30*	CHF	1 950 000		1 000 000	950 000	869 250	0,04
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 18-18.07.28*	CHF	1 360 000		700 000	660 000	631 950	0,03
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.10000% 19-19.06.29*	CHF	1 835 000		1 835 000			
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 19-19.06.34*	CHF	345 000		345 000	294 285	0,01	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.20000% 21-20.05.33*	CHF	5 000 000		2 000 000	3 000 000	2 542 500	0,12
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.10000% 21-28.01.36*	CHF	3 500 000		3 500 000	2 740 500	0,13	
DEUTSCHE BANK AG 0.31500% 21-14.09.27*	CHF		6 600 000	6 600 000	5 897 100	0,27	400 000
DEUTSCHE BANK AG 0.62500% 15-19.12.23*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 390 900	0,06	
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 16-05.07.21*	CHF	500 000		500 000			
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 17-21.03.22*	CHF	2 000 000		2 000 000			
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 18-08.02.23*	CHF	150 000	1 900 000	150 000	1 900 000	1 899 620	0,09
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25*	CHF	200 000		200 000	195 400	0,01	200 000
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG-S 0.43500% 20-06.02.32*	CHF	2 720 000	1 000 000	3 720 000	3 253 140	0,15	
DNB BANK ASA-REG-S 0.12500% 18-30.11.23*	CHF	65 000		65 000	64 513	0,00	
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24*	CHF	2 960 000		2 960 000	2 920 040	0,13	
DNB BANK ASA-REG-S 1.16750% 22-03.06.27*	CHF		2 000 000	2 000 000	1 982 000	0,09	
DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 952 000	0,14	
ELI LILLY & CO-REG-S 0.15000% 16-24.05.24*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 586 400	0,07	
ELI LILLY & CO-REG-S 0.45000% 16-24.05.28*	CHF	955 000		955 000	901 520	0,04	805 000
EMIRATES NBD PJSC 0.62500% 18-09.02.23*	CHF	3 090 000		3 090 000			
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.55000% 17-03.09.24*	CHF	2 295 000		2 295 000	2 277 788	0,10	
ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 0.25000% 21-02.10.28*	CHF		5 100 000	5 100 000	4 582 350	0,21	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.12500% 06-30.06.36*	CHF	375 000		375 000	447 000	0,02	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 0.17000% 17-18.07.25*	CHF	1 270 000		1 270 000			
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.38250% 18-11.07.24*	CHF	1 145 000		1 145 000			
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.07000% 19-18.10.27*	CHF	2 340 000	1 000 000	3 340 000	3 072 800	0,14	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23*	CHF	3 170 000		350 000	2 820 000	2 812 104	0,13
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24*	CHF	3 840 000		3 840 000	3 786 240	0,17	3 200 000
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25*	CHF	2 000 000	1 000 000	800 000	2 200 000	2 118 600	0,10
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.06800% 21-31.03.27*	CHF	4 500 000	3 000 000	1 000 000	6 500 000	6 045 000	0,28
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 762 000	0,17	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 980 000	0,09	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.50000% 17-04.12.24*	CHF	730 000		730 000	719 780	0,03	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 478 250	0,07	200 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.40000% 21-11.05.28*	CHF	2 000 000		4 000 000	3 612 000	0,17	320 000
HEATHROW FUNDING LTD 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	6 585 000	3 850 000	10 435 000	10 304 563	0,47	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.45000% 19-15.10.26*	CHF	3 470 000	1 200 000	4 670 000	4 394 470	0,20	25 000
HENKEL AG & CO KGAA 0.27250% 20-28.04.23*	CHF	2 390 000		1 390 000	1 000 000	1 000 000	0,05
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.32000% 21-03.11.27*	CHF		8 200 000	8 200 000	7 511 200	0,35	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.81250% 21-03.11.31*	CHF	6 200 000		6 200 000	5 297 900	0,24	2 200 000
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26*	CHF	4 200 000		4 200 000	4 179 000	0,19	
HYPOTHEKARER BANK AG-REG-S 0.12500% 19-03.09.29*	CHF	350 000		350 000	302 575	0,01	
HYPOTHEKARER BANK AG-REG-S 0.50000% 22-07.04.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	974 500	0,04	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 3.25000% 07-28.06.24*	CHF	1 975 000		400 000	1 575 000	1 656 113	0,08
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24*	CHF	7 800 000	7 600 000	15 400 000	15 007 300	0,69	
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.30000% 18-18.12.23*	CHF	2 685 000	2 000 000	4 685 000			
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-14.07.28*	CHF	12 120 000	2 000 000	14 120 000			
JPMORGAN CHASE & CO 0.50000% 15-04.12.23*	CHF	1 710 000		610 000	1 100 000	1 097 250	0,05
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.63000% 20-25.02.35*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 412 818	0,06	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.80000% 22-03.02.32*	CHF		5 800 000	5 800 000	5 073 331	0,23	
KIWBANK LTD-REG-S 0.25000% 18-18.10.23*	CHF	670 000		670 000			
KOMMUNALKREDIT AUSTRIA AG 3.37500% 06-22.06.26*	CHF	70 000		70 000	76 125	0,00	
KOMMUNEKREDIT 0.62500% 15-09.07.27*	CHF	415 000		415 000			
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.30300% 18-14.06.23*	CHF	1 190 000		1 190 000			
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25*	CHF	2 845 000		1 845 000	1 000 000	986 500	0,05
KOREA EXPRESSWAY CORP 0.25000% 17-07.06.24*	CHF	705 000		705 000			
KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 0.19250% 20-15.06.25*	CHF	925 000		925 000	901 413	0,04	
KOREA WATER RESOURCES CORP-REG-S 0.15000% 18-20.09.23*	CHF	2 040 000		1 040 000	1 000 000	994 300	0,05
LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.20000% 18-17.04.26*	CHF	160 000		160 000			
LGT BANK AG-REG-S 0.20000% 20-04.11.30*	CHF	2 500 000		2 500 000			
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25*	CHF	1 880 000	800 000	500 000	2 180 000	2 157 110	0,10
LLOYDS BANKING GROUP 0.60250% 22-09.02.29*	CHF		5 000 000	800 000	4 200 000	3 819 900	0,18
MACQUARIE BANK 0.75000% 16-05.02.24*	CHF	2 560 000		500 000	2 060 000	2 058 970	0,09
MACQUARIE BANK LTD 0.62500% 15-04.09.23*	CHF	3 510 000		3 510 000	3 513 861	0,16	
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 0.39500% 21-20.07.28*	CHF		5 320 000	600 000	4 720 000	4 231 480	0,19
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 1.28500% 22-11.09.29*	CHF		11 000 000		11 000 000	10 224 500	0,47
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.25000% 19-15.03.29*	CHF	1 750 000		1 000 000	750 000	701 250	0,03
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.80000% 19-15.03.39*	CHF	650 000		650 000	547 950	0,03	
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.70000% 20-20.04.40*	CHF	170 000		170 000	137 615	0,01	
MBANK SA-REG-S 0.56500% 18-07.06.22*	CHF	2 110 000		2 110 000	2 109 810	0,10	
MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24*	CHF	3 800 000		3 800 000	3 705 000	0,17	
MEDIABANCA INTERNATIONAL LUX SA-REG-S 0.55000% 18-02.03.23*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 000 400	0,05	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 19-11.06.27*	CHF	1 350 000		1 350 000	1 256 850	0,06	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 20-25.09.28*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 355 250	0,06	

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.15000% 21-25.09.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	884 500	0,04		
MFINANCE FRANCE SA 1.00500% 17-28.03.23*	CHF	4 820 000	1 100 000	5 920 000	5 890 992	0,27		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.30000% 17-20.12.24*	CHF	670 000	400 000	1 070 000	1 044 320	0,05		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.35000% 18-12.12.23*	CHF	850 000		850 000	844 475	0,04		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.50000% 18-14.06.28*	CHF	350 000		350 000	335 650	0,02		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.00100% 19-19.02.24*	CHF	1 340 000		1 340 000	1 328 610	0,06		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 19-26.02.29*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 216 800	0,06		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.20000% 19-18.06.31*	CHF	4 335 000	800 000	4 800 000	4 293 600	0,20		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.12500% 19-18.11.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	921 500	0,04		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25*	CHF	2 400 000		2 000 000	1 907 000	0,09		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.20000% 21-03.03.31*	CHF	1 500 000		1 500 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.05000% 21-13.08.36*	CHF	5 000 000		5 000 000	3 922 500	0,18		
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.37500% 22-07.04.26*	CHF	4 900 000		4 900 000	4 799 550	0,22	1 200 000	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25000% 19-31.10.44*	CHF	1 200 000		1 200 000	835 062	0,04		
MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.62500% 17-06.08.38*	CHF	850 000		850 000	722 075	0,03	250 000	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.62500% 13-05.09.23*	CHF	840 000		840 000				
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 18-13.03.24*	CHF	2 350 000		2 350 000				
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.12500% 19-21.06.27*	CHF	440 000		200 000	224 400	0,01		
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.16750% 19-11.07.31*	CHF	150 000	300 000	450 000	400 050	0,02		
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.12500% 19-13.09.23*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 980 800	0,14		
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF	3 800 000		3 800 000	3 744 900	0,17	1 000 000	
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 3.25000% 06-07.08.29*	CHF	810 000		810 000	923 400	0,04		
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 0.00200% 21-04.03.41*	CHF	400 000		400 000	292 800	0,01		
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 19-18.10.27*	CHF	3 865 000	2 865 000	1 000 000	935 500	0,04	200 000	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.37500% 21-23.07.30*	CHF	600 000	600 000	600 000				
NORSKE TOG-REG-S 1.12500% 13-02.05.23*	CHF	1 675 000		1 675 000				
ONTARIO, PROVINCE OF 0.25000% 17-28.06.29*	CHF	1 600 000		600 000	556 800	0,03		
ONTARIO, PROVINCE OF-REG-S 0.05000% 21-12.05.33*	CHF	3 300 000		3 300 000	2 781 900	0,13		
ORANGE SA-REG-S 0.20000% 19-24.11.25*	CHF	2 100 000		2 100 000	2 032 800	0,09		
PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 21-26.10.28*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 632 000	0,17		
PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.75000% 22-02.05.29*	CHF	4 500 000	1 500 000	3 000 000	2 977 500	0,14		
PETROLEOS MEXICANOS 2.37500% 16-14.12.21*	CHF	4 000 000		4 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.62500% 11-29.11.41*	CHF	120 000		120 000	118 476	0,01		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 12-27.04.27*	CHF	5 540 000		5 540 000	5 686 256	0,26	1 000 000	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 16-17.05.40*	CHF	600 000		600 000	465 900	0,02		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 17-23.01.37*	CHF	2 050 000		2 050 000	1 777 350	0,08		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 17-21.12.29*	CHF	1 550 000		1 550 000	1 462 425	0,07		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 17-25.03.24*	CHF	5 000 000	5 000 000					
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 17-25.01.35*	CHF	5 250 000		5 250 000	4 649 925	0,21		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-12.10.27*	CHF	10 500 000		10 500 000	10 073 700	0,46		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-18.09.26*	CHF	500 000		500 000	486 600	0,02		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 18-12.05.27*	CHF	2 250 000		2 250 000	2 183 400	0,10		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.12500% 19-08.05.29*	CHF	11 050 000		11 050 000	10 248 875	0,47		
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPOTHEKA AG 0.12500% 21-19.03.31*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 472 500	0,21		
QNB FINANCE LTD-REG-S 0.02500% 21-03.06.24*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 883 050	0,22		
QUEBEC, PROVINCE OF 0.03000% 21-18.06.31*	CHF	2 000 000	2 400 000	1 000 000	3 005 600	0,14		
QUEBEC, PROVINCE OF-REG-S 0.75000% 14-21.11.24*	CHF	1 020 000		1 020 000	1 022 550	0,05	450 000	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 19-25.11.27*	CHF	400 000		400 000	368 800	0,02		
RABOBANK NEDERLAND NV 1.36250% 22-28.04.28*	CHF	3 600 000		3 600 000	3 526 200	0,16		
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.177500% 21-15.01.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 903 000	0,09		
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.57000% 21-15.01.31*	CHF	1 000 000		1 000 000	895 000	0,04		
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 226 550	0,06		
RCI BANQUE SA 0.50000% 17-20.04.22*	CHF	2 235 000		2 235 000				
RCI BANQUE SA 0.50000% 19-18.07.24*	CHF	2 700 000	1 000 000	1 700 000	1 657 500	0,08		
RCI BANQUE SA-REG-S 0.55000% 18-30.05.23*	CHF	620 000		620 000	617 086	0,03		
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.10000% 18-18.07.23*	CHF	1 000 000		1 000 000				
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.20000% 21-22.09.31*	CHF	8 100 000		8 100 000	6 706 800	0,31	1 410 000	
ROYAL BANK OF CANADA DN-REG-S 0.25000% 21-15.10.29*	CHF	11 400 000		11 400 000	10 083 300	0,46	2 010 000	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.40000% 22-05.10.26*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 910 000	0,18	715 000	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.62500% 18-24.10.22*	CHF	450 000		450 000				
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.15000% 19-10.12.24*	CHF	50 000		50 000				
SCHINDLER HOLDING AG 0.25000% 18-05.06.23*	CHF	1 000 000		1 000 000				
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 758 000	0,17	3 520 000	
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 0.76000% 15-17.06.22*	CHF	50 000		50 000	49 960	0,00		
SITEX PROPERTIES AG 0.37500% 20-17.06.25*	CHF	4 020 000		4 020 000	3 959 700	0,18		
SOCIETE GENERALE 0.37500% 21-26.07.28*	CHF	1 000 000	5 000 000	6 000 000	5 406 000	0,25	1 400 000	
SOCIETE GENERALE 0.40000% 17-22.02.22*	CHF	2 205 000		2 205 000				
SOCIETE GENERALE 2.37500% 12-19.09.22*	CHF	410 000		410 000				
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 19-08.10.26*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 303 400	0,06		
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 20-25.02.27*	CHF	3 800 000	2 400 000	6 200 000	5 648 200	0,26	400 000	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.74500% 22-26.01.29*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 658 000	0,17	1 000 000	
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.70000% 18-26.02.25*	CHF	1 000 000	200 000	1 200 000	1 173 000	0,05		
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.87500% 19-28.02.24*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 198 200	0,06		
SPAREBANK 1 BOLIGKREDIT AS-REG-S 0.50750% 22-06.04.27*	CHF	5 000 000	1 500 000	3 500 000	3 419 500	0,16		
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 19-11.12.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	959 000	0,04		
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 21-15.09.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	900 500	0,04		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.25000% 19-11.10.23*	CHF	5 490 000		5 490 000	5 468 040	0,25	1 000 000	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 1.62500% 14-01.11.24*	CHF	1 720 000		1 720 000	1 709 680	0,08		
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24*	CHF	2 645 000	2 645 000					
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 0.50000% 15-01.06.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 910 000	0,09		
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.28800% 18-13.07.26*	CHF	1 750 000		1 750 000	1 680 000	0,08		
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.000001% 21-21.05.24*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 909 972	0,18		
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.62500% 16-23.06.23*	CHF	3 975 000	3 950 000	3 975 000	3 954 345	0,18		
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.65000% 16-02.11.26*	CHF	9 200 000	1 000 000	10 200 000	9 715 500	0,45		
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 1.00000% 18-08.12.25*	CHF	5 720 000	600 000	6 320 000	6 212 560	0,29		
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 0.87500% 21-19.11.31*	CHF	6 000 000	5 600 000	470 000	11 130 000	9 644 145	0,44	550 000
UBS AG LONDON BRANCH-REG-S 0.15000% 21-29.06.28*	CHF	6 900 000		6 900 000	6 296 250	0,29		
UBS GROUP AG-REG-S 0.87500% 19-30.01.25*	CHF	6 160 000	200 000	6 360 000	6 337 740	0,29		
UNIBAIL-RODAMCO SE 2.00000% 13-20.11.23*	CHF	200 000		200 000	203 560	0,01		
UNICREDIT BANK (IRELAND) PLC 4.25000% 12-19.10.22*	CHF	340 000		340 000	344 964	0,02		
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.37500% 17-31.05.23*	CHF	2 070 000		2 070 000	2 068 965	0,10		
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	670 000	150 000	820 000	794 170	0,04		
VODAFONE GROUP PLC 0.50000% 16-19.09.31*	CHF	2 270 000		2 270 000	2 005 545	0,09	1 990 000	
VODAFONE GROUP PLC 0.62500% 17-15.03.27*	CHF	335 000		335 000	324 113	0,01		
WESTPAC BANKING CORP 0.40000% 15-09.06.23*	CHF	340 000		340 000				
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.30000% 17-28.11.25*	CHF	670 000		670 000	648 225	0,03		
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.50000% 18-16.05.28*	CHF	200 000		200 000				
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.40000% 18-06.06.24*	CHF	1 190 000		1 190 000	1 178 695	0,05	1 190 000	
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.25000% 19-29.01.27*	CHF	340 000		340 000				
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.37500% 16-05.02.24*	CHF	370 000		370 000				
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.12500% 17-15.12.22*	CHF	2 220 000		2 220 000				
WOODSIDE FINANCE LTD 1.00000% 16-11.12.23*	CHF	880 000		880 000	882 640	0,04	430 000	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 1.12500% 22-04.07.29*	CHF	10 000 000		10 000 000	9 730 000	0,45	1 445 000	
Total CHF					677 796 755	31,16		

Total Medium-Term Notes, fester Zins

677 796 755 31,16

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
CHF								
BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 0.00000% 19-24.09.21*	CHF	3 675 000		3 675 000				
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.00000% 18-23.03.23*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 002 100	0,14	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 21-27.01.27*	CHF	2 500 000		2 500 000				
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 21-27.01.33*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 086 250	0,10	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.00000% 19-27.05.25*	CHF	975 000		975 000				
KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 368 500	0,06	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.00000% 19-11.07.25*	CHF	1 005 000			1 005 000	982 890	0,05	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.00000% 21-20.05.41*	CHF	2 640 000			2 640 000	1 912 680	0,09	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-06.06.25*	CHF	1 480 000			1 480 000	1 450 400	0,07	
ZURICH INSURANCE CO LTD-REG-S 0.00000% 21-26.08.31*	CHF		2 400 000		2 400 000	2 028 000	0,09	
Total CHF						12 830 820	0,59	

Total Medium-Term Notes, Nullcoupon

12 830 820 0,59

Anleihen, fester Zins

CHF								
AAREKRAFTWERK KLINGNAU AG-REG-S 0.62500% 19-03.08.29*	CHF		1 000 000		1 000 000	931 000	0,04	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.60000% 12-18.05.37*	CHF	630 000			630 000	613 620	0,03	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02000% 16-17.10.24*	CHF	4 700 000		1 000 000	3 700 000	3 644 500	0,17	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.11000% 17-21.02.24*	CHF	3 175 000		3 175 000				
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.25000% 17-07.09.26*	CHF	705 000			705 000	683 850	0,03	100 000
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.12500% 19-11.02.26*	CHF	500 000			500 000	486 000	0,02	
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.01000% 20-29.06.28*	CHF	1 765 000			1 765 000	1 639 685	0,08	
ABB LTD-REG-S 1.00000% 19-07.05.29*	CHF	300 000			300 000	292 500	0,01	200 000
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 1.05000% 20-26.05.23*	CHF	180 000			180 000	180 918	0,01	
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.35000% 22-24.03.27*	CHF		5 005 000		5 005 000	4 849 845	0,22	
ALLREAL HOLDING AG 0.62500% 16-10.05.24*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 468 500	0,16	
ALLREAL HOLDING AG 0.87500% 17-30.03.27*	CHF	550 000		550 000				
ALLREAL HOLDING AG 1.37500% 15-31.03.25*	CHF	3 605 000			3 605 000	3 608 605	0,17	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-19.06.26*	CHF	1 700 000		700 000	1 000 000	969 500	0,04	
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.50000% 18-19.04.23*	CHF	4 700 000			4 700 000	4 701 410	0,22	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.35000% 17-27.10.21*	CHF	3 000 000		3 000 000				
AMAG LEASING AG-REG-S 0.87500% 17-25.10.24*	CHF	1 175 000			1 175 000	1 159 725	0,05	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.55000% 18-10.02.23*	CHF	6 820 000		820 000	6 000 000	5 994 000	0,28	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 19-12.07.22*	CHF	750 000			750 000	749 850	0,03	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.50000% 19-12.11.25*	CHF	2 250 000			2 250 000	2 152 125	0,10	110 000
AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 20-12.02.24*	CHF	1 350 000			1 350 000	1 321 650	0,06	
AMGEN INC 0.41000% 16-08.03.23*	CHF	1 875 000		1 875 000				
APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24*	CHF	2 875 000		800 000	2 075 000	2 064 625	0,09	
ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 10-12.02.30*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 288 575	0,06	
AXPO HOLDING AG 1.00200% 20-23.07.27*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 451 250	0,07	
AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24*	CHF	800 000	2 000 000		2 800 000	2 846 200	0,13	
AXPO HOLDING AG 3.12500% 10-26.02.25*	CHF	100 000	4 500 000		4 600 000	4 832 300	0,22	350 000
BALOISE HOLDING AG-REG-S 1.12500% 14-19.12.24*	CHF	200 000			200 000	200 800	0,01	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.50000% 19-28.11.25*	CHF	300 000			300 000	292 650	0,01	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26*	CHF	12 400 000	3 800 000		16 200 000	15 122 700	0,70	5 000 000
BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23*	CHF	695 000		695 000				
BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24*	CHF	1 025 000	2 000 000		3 025 000	2 882 825	0,13	
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.87500% 18-14.12.21*	CHF	1 665 000		1 665 000				
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 1.55000% 19-11.10.22*	CHF	2 600 000	1 000 000		3 600 000	3 596 760	0,17	
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	1 500 000	400 000		1 900 000	1 855 350	0,09	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.12500% 17-20.07.27*	CHF	50 000			50 000	47 725	0,00	
BANK CLER AG-REG-S 0.50000% 17-28.11.25*	CHF	900 000			900 000	879 300	0,04	
BANK CLER AG-REG-S 0.37500% 19-26.04.27*	CHF	500 000			500 000	473 250	0,02	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.73250% 22-25.04.29*	CHF		5 500 000		5 500 000	5 307 500	0,24	
BANQUE CANTONALE DE GENEVE-SUB 1.12500% 17-28.06.27*	CHF	250 000			250 000	241 750	0,01	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75000% 11-22.11.24*	CHF	1 050 000			1 050 000	1 077 825	0,05	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.12500% 13-27.03.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 009 600	0,05	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.01000% 21-28.01.33*	CHF	700 000			700 000	588 700	0,03	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.10000% 21-18.03.30*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 355 250	0,06	
BASLER KANTONALBANK 1.50000% 12-02.03.27*	CHF	1 470 000			1 470 000	1 501 605	0,07	200 000
BASLER KANTONALBANK 0.30000% 17-22.06.27*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 106 875	0,05	
BASLER KANTONALBANK 0.15000% 19-02.04.27*	CHF	300 000			300 000	286 950	0,01	
BASLER KANTONALBANK 0.05000% 19-19.12.33*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 407 600	0,06	300 000
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 18-11.04.24*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	1 985 000	0,09	
BELL FOOD GROUP AG 0.62500% 16-24.03.25*	CHF	3 950 000		250 000	3 700 000	3 635 250	0,17	
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.37500% 18-01.02.24*	CHF	1 630 000			1 630 000	1 613 300	0,07	
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.75000% 18-01.02.28*	CHF	250 000			250 000	235 625	0,01	
BERNER KANTONALBANK AG 0.10000% 19-30.09.39*	CHF		1 325 000		1 325 000	961 950	0,04	
BKW AG-REG-S 0.75000% 18-15.10.25*	CHF	200 000			200 000	197 800	0,01	
BKW FMB ENERGIE AG 2.50000% 10-15.10.30*	CHF	2 320 000	150 000		2 470 000	2 610 790	0,12	
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23*	CHF	350 000			350 000	306 250	0,01	
BOBST GROUP SA-REG-S 1.12500% 18-27.09.24*	CHF	250 000			250 000	250 750	0,01	
BOBST GROUP SA-REG-S 0.50000% 20-17.02.26*	CHF	275 000			275 000	263 313	0,01	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.75000% 14-28.02.24*	CHF	1 840 000			1 840 000	1 869 440	0,09	
BUEHLER HOLDING AG-REG-S 0.10000% 17-21.12.22*	CHF	3 240 000			2 000 000	2 000 200	0,09	
BUEHLER HOLDING AG-REG-S 0.60000% 17-21.12.26*	CHF	2 745 000			2 745 000	2 643 435	0,12	
CANTON OF GENEVA SWITZERLAND-REG-S 0.03000% 20-28.06.30*	CHF		5 000 000		5 000 000	4 532 500	0,21	700 000
CANTON OF GENEVA SWITZERLAND-REG-S 0.20000% 20-28.09.35*	CHF		1 000 000		1 000 000	832 500	0,04	
CARIBBEAN DEVELOPMENT BANK 0.29700% 16-07.07.28*	CHF	1 540 000		540 000	1 000 000	944 500	0,04	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 1.25000% 14-14.10.22*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 004 700	0,05	
CEMBRA MONEY BANK AG 0.18000% 16-05.10.23*	CHF	1 550 000			1 550 000	1 536 825	0,07	
CEMBRA MONEY BANK AG 0.37500% 17-27.06.25*	CHF	750 000			750 000	729 000	0,03	330 000
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.25000% 17-23.05.24*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 131 025	0,05	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.28500% 19-19.08.27*	CHF	165 000			165 000	152 790	0,01	165 000
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.15250% 19-14.10.26*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 406 250	0,06	1 000 000
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.41750% 21-15.11.28*	CHF		4 420 000		4 420 000	4 013 360	0,18	535 000
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 1.12500% 14-24.02.23*	CHF	900 000		900 000				
CLARIANT AG-REG-S 1.12500% 19-15.04.26*	CHF	1 000 000	335 000		1 335 000	1 312 305	0,06	
CLARIANT AG-REG-S 2.12500% 14-17.10.24*	CHF	2 500 000	3 500 000		6 000 000	6 099 000	0,28	860 000
COCA-COLA CO/THE 1.00000% 15-02.10.28*	CHF	390 000			390 000	383 760	0,02	
COMET HOLDING AG-REG-S 1.30000% 21-20.04.26*	CHF	845 000			845 000	836 550	0,04	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.87500% 15-31.07.24*	CHF	905 000			905 000	902 738	0,04	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	970 000	0,04	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.25000% 16-30.09.22*	CHF	2 000 000		2 000 000				
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.75000% 18-06.06.25*	CHF	750 000		400 000	350 000	345 450	0,02	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.75000% 20-05.05.23*	CHF	1 000 000		1 000 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.30000% 17-07.04.25*	CHF	455 000			455 000	444 535	0,02	
CREDIT AGRICOLE NEXT BK SUISSE SA-REG-S 0.12500% 21-09.04.31*	CHF	5 400 000			5 400 000	4 773 600	0,22	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.75000% 13-13.03.23*	CHF	350 000		350 000				

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23*	CHF	1 085 000			1 085 000	1 079 901	0,05	
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.20000% 21-15.12.26*	CHF		5 900 000	600 000	5 300 000	4 854 800	0,22	1 520 000
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.55000% 21-16.04.29*	CHF		6 700 000	1 000 000	5 700 000	4 910 550	0,23	
DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 1.70000% 22-30.03.27*	CHF		5 250 000		5 250 000	5 082 000	0,23	
DORMAKABA FINANCE AG 1.00000% 17-13.10.25*	CHF	1 800 000			1 800 000	1 773 000	0,08	1 570 000
DUFREY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26*	CHF	3 110 000			3 110 000	2 904 740	0,13	
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.87500% 18-18.10.23*	CHF	2 240 000			2 240 000	2 243 360	0,10	
EMISSIONS- UND FINANZ AG-REG-S 0.37500% 21-06.05.26*	CHF	1 870 000			1 870 000	1 788 655	0,08	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRAEGER 1.12500% 14-24.09.29*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 989 500	0,14	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRA-REG-S 0.10000% 20-02.11.38*	CHF	1 000 000			1 000 000	781 500	0,04	
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 2.87500% 05-04.02.30*	CHF	3 375 000			3 375 000	3 771 563	0,17	
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 3.00000% 06-15.05.26*	CHF	8 000 000		5 000 000	3 000 000	3 253 500	0,15	
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 3.00000% 07-22.05.24*	CHF	5 520 000		3 970 000	1 550 000	1 627 500	0,07	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.37500% 07-15.10.27*	CHF	375 000			375 000	422 438	0,02	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.62500% 10-11.02.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 056 000	0,05	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.37500% 13-21.02.28*	CHF	2 635 000			2 635 000	2 692 970	0,12	2 635 000
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.75000% 13-28.06.33*	CHF	3 050 000			3 050 000	3 147 600	0,14	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 12-02.04.26*	CHF	1 225 000			1 225 000	1 264 813	0,06	
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.10000% 19-23.10.23*	CHF	100 000			100 000	99 080	0,00	
FERRING HOLDING SA-REG-S 1.05000% 20-09.07.25*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 964 000	0,14	
FIRMENICH INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 20-19.12.23*	CHF	800 000		800 000				
FIRST GULF BANK PJSC 0.62500% 15-27.05.22*	CHF	400 000		400 000				
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.20000% 20-26.02.35*	CHF	270 000			270 000	212 760	0,01	
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.70000% 20-22.05.24*	CHF	460 000			460 000	458 390	0,02	
FLUGHAFEN ZURICH AG 0.62500% 17-24.05.29*	CHF	200 000			200 000	185 900	0,01	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.57800% 19-11.03.24*	CHF	1 280 000			1 280 000	1 270 400	0,06	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.55600% 21-03.09.26*	CHF	3 200 000			3 200 000	3 059 200	0,14	
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.79500% 21-01.12.28*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 787 000	0,13	
FREIBURGER KANTONALBANK 1.45000% 12-07.06.27*	CHF	2 370 000			2 370 000	2 411 475	0,11	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.55000% 15-03.02.25*	CHF	5 000 000		5 000 000				
FREIBURGER KANTONALBANK 0.50000% 16-23.02.28*	CHF	5 300 000		5 300 000				
FREIBURGER KANTONALBANK 0.30000% 17-17.02.27*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 156 200	0,05	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.25000% 19-24.05.29*	CHF	9 000 000		4 000 000	5 000 000	4 622 500	0,21	365 000
FREIBURGER KANTONALBANK 0.10000% 19-01.11.44*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 028 000	0,09	
GALENICA SANTE LTD 0.50000% 17-15.06.23*	CHF	3 500 000	500 000		4 000 000	4 001 600	0,18	
GALENICA SANTE LTD 1.00000% 17-15.12.26*	CHF	270 000			270 000	265 545	0,01	
GAZ CAPITAL SAVGAZPROM LPN 2.75000% 16-30.11.21*	CHF	1 500 000		1 500 000				
GAZ CAPITAL SAVGAZPROM 2.25000% 17-19.07.22*	CHF	300 000		300 000				
GAZ CAPITAL SAVGAZPROM-REG-S 1.45000% 18-06.03.23*	CHF	1 800 000		1 800 000				
GEBERIT AG 0.30000% 15-17.04.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 001 200	0,05	
GEBERIT AG 0.75000% 22-29.09.27*	CHF		3 900 000	900 000	3 000 000	2 932 500	0,13	2 100 000
GEBERIT AG-REG-S 0.10000% 19-17.10.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	986 000	0,05	
GEBERIT AG-REG-S 0.35000% 20-20.10.22*	CHF	400 000		400 000				
GENEVA, CANTON OF 0.50000% 15-27.11.30*	CHF	4 650 000			4 650 000	4 357 050	0,20	
GENEVA, CANTON OF 0.50000% 16-31.10.56*	CHF	4 000 000			4 000 000	2 732 000	0,13	1 670 000
GENEVA, CANTON OF 1.62500% 11-28.11.23*	CHF	100 000			100 000	102 090	0,00	
GENEVA, CANTON OF 1.50000% 12-27.01.28*	CHF	910 000			910 000	933 660	0,04	
GENEVA, CANTON OF 1.50000% 12-28.05.27*	CHF	2 060 000			2 060 000	2 115 620	0,10	490 000
GENEVA, CANTON OF 2.12500% 10-27.10.28*	CHF	2 270 000			2 270 000	2 414 145	0,11	
GENEVA, CANTON OF 2.00000% 11-28.11.41*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 041 500	0,05	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.37500% 14-29.09.34*	CHF	1 000 000			1 000 000	982 000	0,05	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.25000% 17-29.11.27*	CHF	930 000			930 000	895 125	0,04	930 000
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.50000% 17-28.11.31*	CHF	1 550 000			1 550 000	1 434 525	0,07	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.05000% 20-15.11.29*	CHF	13 000 000	2 000 000		15 000 000	13 762 500	0,63	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.25000% 20-15.06.40*	CHF	2 500 000			2 500 000	1 943 750	0,09	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.05000% 21-27.08.41*	CHF		28 000 000		28 000 000	20 384 000	0,94	
GEORG FISCHER LTD-REG-S 0.95000% 20-25.03.30*	CHF	5 765 000	4 000 000		9 765 000	9 159 570	0,42	
GEORGES FISCHER FINANZ AG 0.87500% 16-12.05.26*	CHF	3 250 000			3 250 000	3 198 000	0,15	
GIVAUDAN FINANCE SA-REG-S 0.12500% 21-07.06.27*	CHF		1 935 000		1 935 000	1 819 868	0,08	
GIVAUDAN SA-REG-S 0.37500% 18-09.04.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 970 000	0,09	
GIVAUDAN SA-REG-S 0.15000% 20-10.11.28*	CHF	1 860 000			1 860 000	1 696 320	0,08	830 000
GIVAUDAN SA-REG-S 1.12500% 22-15.06.26*	CHF		1 250 000		1 250 000	1 250 463	0,06	
GIVAUDAN SA-REG-S 1.62500% 22-15.06.29*	CHF		1 780 000		1 780 000	1 776 547	0,08	
GLARNER KANTONALBANK 0.15000% 17-26.09.25*	CHF	1 480 000			1 480 000	1 445 960	0,07	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 18-06.12.24*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 936 000	0,18	750 000
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.40000% 18-30.11.26*	CHF	300 000			300 000	291 750	0,01	
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 0.30000% 21-31.08.28*	CHF	2 100 000			2 100 000	1 920 450	0,09	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 1.25000% 12-14.06.24*	CHF	200 000			200 000	202 700	0,01	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.62500% 15-20.04.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	954 500	0,04	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.25000% 16-10.03.28*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 790 000	0,17	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.12500% 18-29.05.24*	CHF	3 200 000		3 200 000				
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.37500% 19-28.05.32*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 511 300	0,07	
GS CALTEX CORP-REG-S 0.63300% 18-31.01.24*	CHF	595 000		595 000				
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-REG-S 1.50000% 14-28.04.25*	CHF	700 000			700 000	708 050	0,03	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG 0.80000% 17-30.05.22*	CHF	2 160 000		2 160 000				
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 18-26.10.22*	CHF	800 000			800 000	801 520	0,04	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 0.87500% 19-08.05.24*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 386 700	0,06	20 000
HIRSLANDEN AG-REG-S 1.25000% 21-25.02.26*	CHF	1 900 000			1 900 000	1 841 100	0,08	
IMPLENIA AG-REG-S 1.62500% 14-15.10.24*	CHF	5 300 000			5 300 000	5 194 000	0,24	1 880 000
IMPLENIA AG-REG-S 1.00000% 16-20.03.26*	CHF		1 000 000		1 000 000	920 000	0,04	150 000
IMPLENIA AG-REG-S 2.00000% 21-26.11.25*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 932 000	0,09	2 000 000
INTERSHOP HOLDING AG 1.12500% 15-17.04.23*	CHF	1 385 000			1 385 000	1 390 817	0,06	
INVESTIS HOLDING SA 0.75000% 17-03.10.22*	CHF	2 185 000	3 250 000	1 750 000	3 685 000	3 689 054	0,17	
JULIUS BAER GROUP-REG-S 0.37500% 17-06.12.24*	CHF	450 000			450 000	441 900	0,02	
KANTONSSPITAL BADEN AG-REG-S 0.35000% 21-30.09.36*	CHF		3 250 000		3 250 000	2 585 375	0,12	285 000
KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY NATIONAL CO JSC 3.25000% 18-05.12.23*	CHF	710 000		710 000				
KEB HANA BANK-REG-S 0.40750% 18-14.09.23*	CHF	2 635 000			2 635 000	2 629 994	0,12	
KRAFTWERKE HINTERRHEIN 2.37500% 10-28.07.22*	CHF	200 000		200 000				
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.75000% 11-09.06.23*	CHF	200 000			200 000	204 400	0,01	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.87500% 11-30.06.31*	CHF	200 000			200 000	211 100	0,01	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 3.00000% 12-27.09.52*	CHF	50 000			50 000	52 575	0,00	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 3.00000% 13-02.04.48*	CHF		100 000		100 000	107 350	0,00	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 0.50000% 15-09.09.21*	CHF	5 930 000		5 930 000				
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.00000% 17-11.12.23*	CHF	500 000			500 000	508 750	0,02	
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.02000% 19-18.11.22*	CHF	13 060 000		13 060 000				
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.20000% 19-18.06.25*	CHF	820 000			4 320 000	4 203 360	0,19	
LIECHTENSTEINISCHE LANDESBANK AG-REG-S 0.12500% 19-28.05.26*	CHF	300 000			300 000	285 300	0,01	
LONZA SWISS FINANCE AG 3.00000% 12-11.10.22*	CHF	7 400 000		2 400 000	5 000 000	5 054 500	0,23	
LONZA SWISS FINANCE AG 1.25000% 15-22.09.23*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 529 750	0,16	
LONZA SWISS FINANCE AG 0.70000% 17-12.07.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 990 000	0,09	2 000 000
LUZERNER KANTONALBANK AG 1.87500% 10-26.11.35*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 118 150	0,05	
LUZERNER KANTONALBANK 2.00000% 10-06.12.33*	CHF	500 000			500 000	518 750	0,02	
LUZERNER KANTONALBANK 1.62500% 12-20.07.37*	CHF	510 000			510 000	499 290	0,02	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.85000% 19-12.03.42*	CHF	1 950 000			1 950 000	1 648 725	0,08	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 19-07.10.44*	CHF	1 500 000	5 000 000		6 500 000	4 572 750	0,21	
LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S-SUB 0.87500% 21-14.05.31*	CHF	6 320 000			6 320 000	5 751 200	0,26	
MOBIMO HOLDING AG 0.75000% 17-20.03.26*	CHF	3 155 000			3 155 000	3 074 548	0,14	
MOBIMO HOLDING AG 1.87500% 14-16.09.24*	CHF	1 150 000			1 150 000	1 168 400	0,05	
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.87500% 18-02.10.23*	CHF	8 650 000			8 650 000	8 647 405	0,40	
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 20-23.03.28*	CHF	400 000		400 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 20-18.09.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 728 500	0,13	
NANT DE DRANCE SA 1.75000% 14-18.07.24*	CHF	200 000			200 000	203 200	0,01	
NANT DE DRANCE SA 2.37500% 13-15.02.28*	CHF	200 000			200 000	208 200	0,01	
NANT DE DRANCE SA 2.00000% 16-02.02.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 024 500	0,05	115 000
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.55000% 18-19.08.25*	CHF	250 000			250 000	252 625	0,01	125 000
NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.25000% 20-25.06.27*	CHF	435 000			435 000	428 040	0,02	
NANT DE DRANCE SA-REG-S 0.87500% 20-23.05.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 875 000	0,09	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.30000% 17-31.10.25*	CHF	510 000			510 000	494 955	0,02	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 0.20000% 16-07.11.31*	CHF	2 500 000		400 000	2 100 000	1 861 650	0,09	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 0.25000% 17-19.01.29*	CHF	1 470 000			1 470 000	1 378 125	0,06	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.30000% 18-24.07.26*	CHF	265 000		265 000				
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.20000% 20-28.11.28*	CHF	950 000		755 000	195 000	180 083	0,01	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.55000% 20-27.05.33*	CHF	1 665 000		665 000	1 000 000	873 000	0,04	
OC OERLIKON CORP AG 2.62500% 14-17.06.24*	CHF	1 300 000			1 300 000	1 328 600	0,06	
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.37500% 21-27.11.25*	CHF	3 800 000	1 000 000		4 800 000	4 514 400	0,21	250 000
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.87500% 05-25.02.30*	CHF	3 800 000	1 155 000	1 700 000	3 255 000	3 663 503	0,17	
ORIOR AG 0.62500% 17-26.09.23*	CHF	4 595 000	3 105 000		7 700 000	7 646 100	0,35	500 000
PARTNERS GROUP HOLDING AG 0.15000% 17-07.06.24*	CHF	3 250 000			3 250 000	3 207 750	0,15	
PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 1.75000% 18-04.12.23*	CHF	20 000		20 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER AG-REG-S 0.25000% 21-25.04.42*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 519 000	0,07	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER-REG-S 1.00000% 15-25.01.36*	CHF		10 000 000	10 000 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HY-REG-S 1.12500% 22-08.04.52*	CHF		1 000 000		1 000 000	899 100	0,04	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 2.25000% 10-13.08.32*	CHF	8 905 000			8 905 000	9 557 737	0,44	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.87500% 10-15.09.31*	CHF	6 640 000			6 640 000	6 914 232	0,32	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 2.12500% 10-01.12.28*	CHF	2 490 000			2 490 000	2 637 657	0,12	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 2.50000% 11-30.03.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 062 700	0,05	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 2.37500% 11-27.06.25*	CHF	8 685 000			8 685 000	9 122 724	0,42	700 000
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 12-21.01.28*	CHF	4 040 000			4 040 000	4 131 708	0,19	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 12-02.08.33*	CHF	4 200 000			4 200 000	4 181 100	0,19	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 12-13.08.27*	CHF	3 020 000			3 020 000	3 077 682	0,14	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.62500% 13-03.07.30*	CHF	4 060 000			4 060 000	4 153 380	0,19	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 2.12500% 14-03.03.44*	CHF	300 000			300 000	322 260	0,01	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 14-14.11.24*	CHF	6 950 000		3 950 000	3 000 000	3 058 200	0,14	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 14-15.12.25*	CHF	8 000 000			8 000 000	8 197 600	0,38	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.00000% 14-07.07.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 512 500	0,12	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 14-23.08.24*	CHF	500 000		500 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.50000% 14-09.11.35*	CHF	6 600 000			6 600 000	6 491 100	0,30	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 14-05.12.40*	CHF	1 650 000			1 650 000	1 596 375	0,07	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 14-19.03.25*	CHF	9 995 000			9 995 000	9 990 003	0,46	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 15-25.04.33*	CHF	8 850 000			8 850 000	8 041 110	0,37	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 15-25.01.34*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 246 000	0,10	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.87500% 15-25.06.37*	CHF	2 250 000			2 250 000	2 005 875	0,09	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 15-24.01.25*	CHF	3 450 000			3 450 000	3 438 270	0,16	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.00000% 15-12.05.32*	CHF	1 850 000			1 850 000	1 769 340	0,08	250 000
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-26.01.26*	CHF	9 200 000			9 200 000	9 056 480	0,42	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 15-16.05.31*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 871 000	0,09	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-15.10.25*	CHF	7 800 000			7 800 000	7 702 500	0,35	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.00000% 15-25.01.36*	CHF		10 000 000		10 000 000	9 235 000	0,42	400 000
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 15-15.06.29*	CHF	8 500 000			8 500 000	8 079 250	0,37	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.75000% 15-28.11.34*	CHF	1 250 000			1 250 000	1 127 875	0,05	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 16-05.08.26*	CHF	4 160 000			4 160 000	4 051 424	0,19	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-06.09.28*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 405 800	0,06	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 16-05.10.35*	CHF	3 225 000			3 225 000	2 794 463	0,13	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-15.12.27*	CHF	2 250 000			2 250 000	2 136 375	0,10	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 16-08.07.39*	CHF	3 550 000			3 550 000	2 853 135	0,13	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 16-04.08.38*	CHF	1 550 000			1 550 000	1 235 350	0,06	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-15.07.31*	CHF	1 000 000			1 000 000	890 000	0,04	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 16-15.06.46*	CHF	450 000			450 000	335 610	0,02	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 16-23.09.43*	CHF	2 245 000			2 245 000	1 720 344	0,08	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 16-14.10.36*	CHF	340 000			340 000	278 290	0,01	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 17-06.05.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	984 000	0,05	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 17-21.03.28*	CHF	2 250 000			2 250 000	2 157 075	0,10	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-18.01.27*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 454 550	0,07	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-20.10.26*	CHF	2 600 000			2 600 000	2 525 380	0,12	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-27.04.26*	CHF	2 420 000			2 420 000	2 365 792	0,11	2 335 000
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 18-17.11.25*	CHF	10 425 000		4 425 000	6 000 000	5 892 000	0,27	40 000
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYP INST-REG-S 0.50000% 18-22.01.29*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 624 520	0,07	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.87500% 19-15.03.40*	CHF	50 000			50 000	43 600	0,00	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 19-10.12.30*	CHF	10 000 000			10 000 000	9 005 000	0,41	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-17.06.41*	CHF	1 200 000			1 200 000	966 600	0,04	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-25.01.44*	CHF	900 000			900 000	702 450	0,03	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 20-22.06.40*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 622 000	0,07	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-07.06.28*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 823 600	0,13	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 20-06.10.42*	CHF	33 745 000		15 000 000	18 745 000	14 122 483	0,65	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-02.08.30*	CHF	8 000 000			8 000 000	7 252 000	0,33	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-19.11.32*	CHF	7 700 000			7 700 000	6 664 350	0,31	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 21-20.06.31*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 670 000	0,12	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 21-21.12.35*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 494 500	0,11	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 21-19.12.31*	CHF		5 000 000		5 000 000	4 408 000	0,20	300 000
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 22-19.12.31*	CHF		5 000 000	5 000 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 22-20.09.29*	CHF		2 000 000	2 000 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 22-09.04.32*	CHF		2 405 000		2 405 000	2 386 001	0,11	450 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN AG 0.25000% 17-01.12.25*	CHF	160 000			160 000	157 424	0,01	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 2.00000% 10-30.10.25*	CHF	22 050 000		8 000 000	14 050 000	14 634 480	0,67	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.62500% 11-31.10.24*	CHF	80 000			80 000	82 024	0,00	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.62500% 12-17.04.28*	CHF	1 070 000			1 070 000	1 101 244	0,05	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.50000% 12-21.05.29*	CHF	820 000			820 000	834 842	0,04	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.25000% 12-17.07.24*	CHF	80 000			80 000	81 256	0,00	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.37500% 13-05.11.27*	CHF	3 840 000			3 840 000	3 904 128	0,18	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.50000% 13-21.06.28*	CHF	1 980 000			1 980 000	2 022 570	0,09	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.62500% 14-17.06.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 575 500	0,12	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.50000% 14-05.02.29*	CHF	2 950 000			2 950 000	3 006 345	0,14	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.75000% 14-23.09.24*	CHF	9 725 000		1 000 000	8 725 000	8 765 135	0,40	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.00000% 14-22.09.28*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 190 160	0,05	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-12.02.30*	CHF	3 890 000			3 890 000	3 698 223	0,17	700 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 15-14.02.25*	CHF	500 000			500 000	496 450	0,02	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-16.07.29*	CHF	2 400 000			2 400 000	2 298 960	0,11	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-17.07.24*	CHF	33 000 000		30 000 000	3 000 000	2 977 200	0,14	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-25.02.26*	CHF	7 250 000			7 250 000	7 063 675	0,32	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.60000% 16-11.12.35*	CHF	10 150 000		500 000	9 650 000	8 42		

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 16-30.03.34*	CHF 400 000			400 000	353 000	0,02	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.30000% 16-06.06.31*	CHF 9 600 000		9 600 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 16-02.09.31*	CHF 5 225 000			5 225 000	4 637 188	0,21	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 16-02.12.24*	CHF 800 000			800 000	790 720	0,04	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 17-20.02.32*	CHF 550 000			550 000	502 425	0,02	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 17-07.12.26*	CHF 1 400 000			1 400 000	1 367 660	0,06	240 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.25000% 17-26.05.27*	CHF 3 325 000			3 325 000	3 206 963	0,15	100 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.25000% 17-12.05.26*	CHF 1 100 000			1 100 000	1 074 810	0,05	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 17-24.07.28*	CHF 1 900 000			1 900 000	1 812 600	0,08	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.25000% 17-06.12.27*	CHF 830 000			830 000	793 895	0,04	830 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 18-19.05.28*	CHF 3 250 000			3 250 000	3 132 350	0,14	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 18-24.11.28*	CHF 1 050 000			1 050 000	1 007 055	0,05	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 18-31.10.24*	CHF 4 720 000		4 720 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.30000% 19-09.04.29*	CHF 8 250 000			8 250 000	7 750 875	0,36	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.70000% 19-04.03.39*	CHF 1 550 000			1 550 000	1 322 925	0,06	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 19-15.05.34*	CHF 2 500 000			2 500 000	2 202 500	0,10	800 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.10000% 19-03.12.31*	CHF 5 000 000			5 000 000	4 403 000	0,20	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.20000% 20-13.07.35*	CHF 10 000 000		10 000 000				
PRIMEO HOLDING AG 0.10000% 21-28.09.29*	CHF	1 560 000		1 560 000	1 399 320	0,06	
PSP SWISS PROPERTY AG 1.00000% 15-06.02.25*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 494 000	0,07	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.50000% 16-16.02.24*	CHF 6 105 000			6 105 000	6 074 475	0,28	
PSP SWISS PROPERTY AG 0.37500% 16-29.04.26*	CHF 2 000 000		1 000 000	1 000 000	959 500	0,04	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.70000% 19-08.02.27*	CHF 1 450 000			1 450 000	1 393 450	0,06	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.20000% 21-04.02.31*	CHF 1 500 000		1 500 000				
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 3.12500% 06-15.09.26*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 157 000	0,10	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 2.62500% 11-04.02.26*	CHF 250 000			250 000	264 000	0,01	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.30000% 16-22.04.25*	CHF 1 200 000		200 000	1 000 000	981 000	0,05	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.35000% 18-16.02.24*	CHF 3 000 000			3 000 000	2 986 500	0,14	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.18250% 20-11.11.25*	CHF 1 000 000			1 000 000	973 000	0,04	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.50000% 20-11.11.28*	CHF 3 000 000			3 000 000	2 797 500	0,13	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 1.50000% 20-23.11.34*	CHF 1 400 000			1 400 000	1 266 300	0,06	1 300 000
RIETER HOLDING AG-REG-S 1.55000% 20-17.09.24*	CHF 6 150 000			6 150 000	6 116 175	0,28	
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.10000% 17-23.09.24*	CHF 200 000			200 000	198 100	0,01	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.75000% 22-25.02.31*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 766 000	0,17	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 1.00000% 22-25.02.37*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 349 250	0,06	
RZD CAPITAL PLC 2.10000% 17-02.10.23*	CHF 750 000	2 000 000	750 000	2 000 000	200 000	0,01	
SCHAFFHAUSER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 18-31.05.28*	CHF 1 600 000			1 600 000	1 533 600	0,07	
SGS SA 0.25000% 15-08.05.23*	CHF 2 400 000		2 400 000				
SGS SA 1.75000% 14-27.02.24*	CHF 120 000			120 000	121 920	0,01	
SGS SA-REG-S 0.45000% 20-06.11.23*	CHF 460 000			460 000	458 942	0,02	
SGS SA-REG-S 0.95000% 20-06.11.26*	CHF 215 000			215 000	211 453	0,01	
SIKA AG-REG-S 0.62500% 18-12.07.24*	CHF 500 000			500 000	499 000	0,02	
SIX GROUP AG-REG-S 0.20000% 21-28.09.29*	CHF	3 205 000		3 205 000	2 897 320	0,13	
SIX GROUP AG-REG-S 0.12500% 21-27.11.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 896 000	0,09	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-06.04.22*	CHF 6 000 000		6 000 000				
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.75000% 20-06.10.28*	CHF 5 990 000	7 000 000		12 990 000	12 496 380	0,57	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.05000% 22-19.02.29*	CHF	3 120 000		3 120 000	3 048 240	0,14	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 1.40000% 22-19.02.32*	CHF	6 370 000		6 370 000	6 169 345	0,28	
ST GALLER KANTONALBANK 1.37500% 12-22.06.27*	CHF 720 000			720 000	730 440	0,03	120 000
ST GALLER KANTONALBANK 0.50000% 15-24.06.25*	CHF 2 950 000		1 500 000	1 450 000	1 436 225	0,07	
ST GALLER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.00000% 17-30.11.27*	CHF 2 930 000			2 930 000	2 806 940	0,13	
ST GALLER KANTONALBANK AG 0.10000% 19-10.10.41*	CHF 150 000	9 000 000		9 150 000	6 652 050	0,31	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S 0.35000% 19-24.01.28*	CHF 500 000			500 000	477 250	0,02	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S 0.25000% 21-30.04.35*	CHF 2 000 000			2 000 000	1 662 000	0,08	300 000
STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-03.10.25*	CHF 1 600 000			1 600 000	1 571 200	0,07	
SULZER AG 0.37500% 16-11.07.22*	CHF	7 000 000		7 000 000	6 995 800	0,32	
SULZER AG-REG-S 0.62500% 18-22.10.21*	CHF 2 700 000		2 700 000				
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF 5 550 000	2 430 000	550 000	7 430 000	7 407 710	0,34	
SULZER AG-REG-S 1.60000% 18-22.10.24*	CHF 800 000			800 000	792 400	0,04	
SWISS CONFEDERATION GOVERNMENT BOND-REG 0.50000% 21-24.05.55*	CHF	500 000	500 000				
SWISS LIFE HOLDING AG 1.87500% 13-21.06.23*	CHF 8 000 000		2 000 000	6 000 000	6 093 600	0,28	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 2.00000% 14-10.12.24*	CHF 1 200 000			1 200 000	1 225 800	0,06	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.82500% 17-11.05.26*	CHF 250 000			250 000	244 875	0,01	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24*	CHF 6 825 000			6 825 000	6 828 413	0,31	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27*	CHF 10 940 000		3 940 000	7 000 000	6 912 500	0,32	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.65000% 20-18.12.29*	CHF 4 375 000	500 000	1 875 000	3 000 000	2 743 500	0,13	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 21-11.02.28*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 395 750	0,06	
SWISSCOM AG 0.12500% 16-15.09.32*	CHF 3 500 000	50 000		3 550 000	2 992 650	0,14	2 670 000
SWISSCOM AG 0.13000% 20-18.09.31*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 578 500	0,12	1 125 000
SWISSCOM AG 0.37500% 16-31.03.28*	CHF 3 000 000	150 000		3 150 000	2 970 450	0,14	2 795 000
SWISSCOM AG 0.37500% 16-15.12.27*	CHF 750 000			750 000	723 750	0,03	750 000
SWISSCOM AG 0.37500% 17-31.05.27*	CHF 2 000 000			2 000 000	1 908 000	0,09	
SWISSCOM AG 1.00000% 15-17.04.35*	CHF 1 800 000	100 000		1 900 000	1 694 800	0,08	200 000
SWISSCOM AG 1.50000% 14-14.07.26*	CHF 2 050 000	100 000		2 150 000	2 189 775	0,10	815 000
SWISSCOM AG 2.62500% 10-31.08.22*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 014 200	0,09	
SWISSCOM AG-REG-S 0.75000% 17-24.11.33*	CHF 3 000 000	4 200 000		7 200 000	6 325 200	0,29	
SWISSCOM AG-REG-S 0.50000% 19-15.03.29*	CHF 5 500 000	200 000		5 700 000	5 338 050	0,25	
SWISSCOM AG-REG-S 0.75000% 18-12.10.28*	CHF 3 400 000	100 000		3 500 000	3 354 750	0,15	
SWISSCOM AG-REG-S 0.25000% 21-18.05.33*	CHF 1 570 000	3 000 000		4 570 000	3 838 800	0,18	385 000
SWISSCOM AG-REG-S 1.50000% 14-28.09.29*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 497 750	0,07	265 000
SWISSGRID AG 0.62500% 15-25.02.30*	CHF 500 000			500 000	465 000	0,02	
SWISSGRID AG-REG-S 0.20000% 20-30.06.32*	CHF 200 000			200 000	170 700	0,01	
SWISSGRID AG-REG-S 0.12500% 20-30.06.36*	CHF 2 500 000			2 500 000	1 926 250	0,09	
SWITZERLAND 1.25000% 12-27.06.37*	CHF 22 730 000			22 730 000	23 418 719	1,08	
SWITZERLAND 1.50000% 12-30.04.42*	CHF 16 550 000			16 550 000	18 084 185	0,83	
SWITZERLAND 2.00000% 14-25.06.64*	CHF 7 085 000			7 085 000	9 590 965	0,44	7 085 000
SWITZERLAND 2.25000% 11-22.06.31*	CHF 12 313 000			12 313 000	13 863 207	0,64	
SWITZERLAND 2.50000% 06-08.03.36*	CHF 1 450 000	5 000 000		6 450 000	7 654 860	0,35	
SWITZERLAND 3.50000% 03-08.04.33*	CHF 10 010 000			10 010 000	12 648 636	0,58	
SWITZERLAND 4.00000% 99-06.01.49*	CHF 9 710 000	4 000 000		13 710 000	23 073 930	1,06	8 709 000
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF 6 150 000			6 150 000	6 060 825	0,28	921 000
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 16-30.05.58*	CHF 5 950 000			5 950 000	5 109 860	0,23	800 000
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-24.05.55*	CHF 300 000	500 000		800 000	696 480	0,03	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-28.06.45*	CHF 13 800 000			13 800 000	12 264 060	0,56	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 18-27.06.32*	CHF 6 463 000	5 000 000		11 463 000	11 034 284	0,51	4 143 000
SWITZERLAND-REG-S 0.25000% 21-23.06.35*	CHF	10 000 000		10 000 000	9 103 000	0,42	
SWITZERLAND-REG-S 0.25000% 22-23.06.35*	CHF	10 000 000	10 000 000				
SWITZERLAND-REG-S 4.00000% 22-06.01.49*	CHF	4 000 000	4 000 000				
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.12500% 20-09.12.22*	CHF 600 000			600 000	598 560	0,03	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.70000% 20-09.12.26*	CHF 500 000			500 000	467 000	0,02	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23*	CHF 1 900 000			1 900 000	1 892 020	0,09	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 872 500	0,22	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 19-03.12.21*	CHF 900 000		900 000				
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 0.60000% 20-07.11.22*	CHF 1 585 000	800 000		2 385 000	2 370 690	0,11	

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TEMENOS GROUP AG 2.00000% 15-17.06.22*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 999 600	0,09	
TESSIN, CANTON OF 0.40000% 16-27.06.44*	CHF	100 000		100 000	76 800	0,00	
TESSIN, CANTON OF 2.12500% 10-24.11.34*	CHF	3 040 000		3 040 000	3 210 240	0,15	3 040 000
TESSINER STAATSBANK-SUB 3.75000% 11-15.12.21*	CHF	475 000		475 000			
THURGAUER KANTONALBANK 1.75000% 13-30.09.24*	CHF	600 000		600 000	614 700	0,03	
THURGAUER KANTONALBANK 1.37500% 14-28.08.23*	CHF	500 000	500 000				
THURGAUER KANTONALBANK 0.70000% 18-22.03.30*	CHF	1 250 000		1 250 000	1 184 375	0,05	250 000
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.16600% 19-21.12.29*	CHF	1 815 000	1 000 000	815 000	722 498	0,03	
TRANSPORTS PUBLICS GENEVOIS 0.90000% 15-21.05.35*	CHF	340 000		340 000	310 080	0,01	
TRANSPOWER NEW ZEALAND LTD 0.02000% 19-16.12.27*	CHF	1 885 000		1 885 000	1 758 705	0,08	
UBS AG/LONDON-REG-S 0.17000% 20-13.05.22*	CHF	2 400 000	2 400 000				
UBS GROUP AG 0.37500% 21-24.08.29*	CHF	4 400 000	1 200 000	5 600 000	5 003 600	0,23	
UBS GROUP AG-REG-S 0.62500% 17-18.05.24*	CHF	3 600 000	1 800 000	5 400 000	5 405 400	0,25	
UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26*	CHF	800 000		800 000	798 000	0,04	600 000
UNION BANCAIRE PRIVÉE UBP SA 0.20000% 21-15.12.26*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 835 000	0,13	
VALIANT BANK AG 0.12500% 19-04.12.34*	CHF	2 150 000		2 150 000	1 747 950	0,08	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.10000% 21-07.05.31*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 629 500	0,12	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.55500% 21-24.03.31*	CHF	4 000 000	500 000	3 500 000	3 041 500	0,14	
VIFOR PHARMA AG-REG-S 0.75000% 18-13.09.22*	CHF	1 850 000		1 850 000	1 851 665	0,09	
WALLISER KANTONALBANK 0.20000% 17-02.02.26*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 917 500	0,13	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.35000% 18-07.09.27*	CHF	1 750 000		1 750 000	1 673 875	0,08	
WINTERTHUR, CITY OF 1.87500% 12-20.04.37*	CHF	430 000		430 000	433 225	0,02	
WINTERTHUR, CITY OF 1.50000% 13-24.01.36*	CHF	620 000		620 000	603 570	0,03	
WINTERTHUR, CITY OF 2.25000% 14-10.02.39*	CHF	200 000		200 000	212 000	0,01	
ZUERCHER KANTONALBANK 2.00000% 10-08.09.25*	CHF	2 100 000		2 100 000	2 178 750	0,10	
ZUERCHER KANTONALBANK 2.00000% 10-30.11.34*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 554 000	0,07	
ZUERCHER KANTONALBANK 2.50000% 11-10.06.31*	CHF	5 000 000		5 000 000	5 432 500	0,25	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.75000% 15-28.10.30*	CHF	12 400 000		12 400 000	11 718 000	0,54	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.05000% 16-23.11.26*	CHF	7 550 000		7 550 000	7 225 350	0,33	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.25000% 17-27.01.26*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 464 750	0,07	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 18-25.01.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 856 000	0,13	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 18-08.05.25*	CHF	1 450 000	1 000 000	450 000	444 375	0,02	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 19-06.06.29*	CHF	1 750 000		1 750 000	1 610 000	0,07	200 000
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 20-05.02.31*	CHF	7 050 000	5 000 000	12 050 000	10 652 200	0,49	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 20-04.11.32*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 557 500	0,12	200 000
ZUERCHER KANTONALBANK 0.20000% 22-31.07.30*	CHF	6 000 000		6 000 000	5 427 000	0,25	900 000
ZUERCHER KANTONALBANK 2.50000% 22-10.06.31*	CHF	5 000 000	5 000 000				
ZUERCHER KANTONALBANK 0.20000% 22-31.03.25*	CHF	6 000 000		6 000 000	5 913 000	0,27	500 000
ZUG ESTATES HOLDING AG 0.70000% 17-17.02.22*	CHF	1 250 000	1 250 000				
ZUG ESTATES HOLDING AG-REG-S 0.10000% 19-02.10.25*	CHF	2 680 000		2 680 000	2 567 440	0,12	260 000
ZUGER KANTONALBANK AG 1.50000% 11-28.11.23*	CHF	200 000	200 000				
ZUGER KANTONALBANK AG 0.37500% 16-15.12.27*	CHF	100 000		100 000	95 750	0,00	
ZUGER KANTONALBANK AG 0.12500% 19-27.06.30*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 350 750	0,06	
ZURICH INSURANCE CO 1.50000% 14-22.07.26*	CHF	850 000		850 000	859 775	0,04	85 000
Total CHF					1 149 687 192	52,85	

Total Anleihen, fester Zins

1 149 687 192 52,85

Anleihen, Nullcoupon

CHF

AMAG LEASING AG-REG-S 0.00000% 21-18.02.25*	CHF	4 500 000		4 500 000	4 383 000	0,20	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-25.09.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	942 500	0,04	500 000
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 19-23.08.34*	CHF	7 725 000	1 500 000	9 225 000	7 463 025	0,34	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.00000% 19-19.05.23*	CHF	3 140 000		3 140 000	3 125 870	0,14	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 19-16.07.29*	CHF	2 025 000		2 025 000	1 834 650	0,08	
FREIBURGER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-26.02.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	897 000	0,04	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.00000% 21-05.02.31*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 506 000	0,16	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.00000% 19-23.09.59*	CHF	1 200 000		1 200 000	643 800	0,03	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 19-16.10.29*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 712 000	0,12	
KANTONSPITAL WINTERTHUR-REG-S 0.00000% 21-30.09.25*	CHF	1 500 000	1 500 000	1 500 000	1 453 500	0,07	
KOREA RAILROAD CORP-REG-S 0.00000% 19-13.06.25*	CHF	2 490 000		2 490 000	2 410 320	0,11	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-07.08.28*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 315 000	0,11	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24*	CHF	650 000	650 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-26.08.49*	CHF	4 875 000		4 875 000	3 131 700	0,14	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 596 300	0,07	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 20-10.05.45*	CHF	2 850 000		2 850 000	1 943 700	0,09	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-14.06.24*	CHF	2 500 000	2 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-27.01.27*	CHF	2 800 000		2 800 000	2 682 400	0,12	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-02.10.26*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 538 720	0,07	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 19-23.06.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	980 000	0,05	1 000 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 20-02.04.31*	CHF	1 850 000		1 850 000	1 636 325	0,08	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBK-REG-S 0.00000% 20-15.03.30*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 356 000	0,06	
PSP SWISS PROPERTY AG 0.00000% 16-01.09.23*	CHF	13 715 000	250 000	13 465 000	13 380 171	0,62	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.00000% 19-06.02.30*	CHF	1 250 000		1 250 000	1 081 875	0,05	50 000
SWISSCOM AG-REG-S 0.00000% 19-30.08.44*	CHF	3 450 000		3 450 000	2 182 125	0,10	300 000
SWISSGRID AG-REG-S 0.00000% 20-30.06.28*	CHF	800 000		800 000	735 600	0,03	
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 16-22.06.29*	CHF	7 752 000		7 752 000	7 425 641	0,34	
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-26.06.34*	CHF	1 347 000		1 347 000	1 203 410	0,06	
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-24.07.39*	CHF	5 689 000		5 689 000	4 750 315	0,22	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.07.29*	CHF	1 900 000		1 900 000	1 715 700	0,08	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.10.25*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 650 700	0,08	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-14.02.29*	CHF	4 500 000		4 500 000	4 108 500	0,19	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-12.03.30*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 524 050	0,07	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.00000% 21-21.01.33*	CHF	5 000 000	5 000 000	10 000 000	8 455 000	0,39	
Total CHF					94 764 896	4,36	

Total Anleihen, Nullcoupon

94 764 896 4,36

Anleihen, variabler Zins

CHF

BALOISE LIFE LTD-SUB 2.200%/VAR 17-19.06.48*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 421 250	0,07	35 000
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERU-REG-S-SUB 1.450%/VAR 20-12.08.40*	CHF	1 000 000		1 000 000	877 500	0,04	890 000
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-25.09.48*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 945 000	0,09	
Total CHF					4 243 750	0,20	

Total Anleihen, variabler Zins

4 243 750 0,20

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

2 132 853 520 98,05

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

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

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF							
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.000000% 21-16.08.23**	CHF	5 000 000		5 000 000	4 877 400	0,22	
Total CHF					4 877 400	0,22	

Total Medium-Term Notes, fester Zins

4 877 400 **0,22**

Anleihen, fester Zins

CHF							
UBS AG/LONDON 0.710000% 22-13.04.25**	CHF	2 000 000		2 000 000	1 979 780	0,09	
Total CHF					1 979 780	0,09	

Total Anleihen, fester Zins

1 979 780 **0,09**

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

6 857 180 **0,32**

Total Wertschriften					2 139 710 700	98,37	
(davon ausgeliehen)					141 732 679	6,52	

Bankguthaben auf Sicht					24 559 363	1,13	
Derivative Finanzinstrumente					1 412 890	0,06	
Sonstige Vermögenswerte					9 554 130	0,44	
Gesamtfondsvermögen					2 175 237 083	100,00	

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-12 316 587		
Andere Verbindlichkeiten					-51 569		
Nettofondsvermögen					2 162 868 927		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 31.5.2022	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	2 132 853 520	98,05
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	8 270 070	0,38
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	2 141 123 590	98,43

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.225000% 22-17.05.32**	47 000 000	CHF	47 000 000	676 198	0.03
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-17.05.32	47 000 000	CHF			
LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.740000% 22-18.05.27**	88 000 000	CHF	88 000 000	736 692	0.03
LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-18.05.27	88 000 000	CHF			
			135 000 000	1 412 890	0.06

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.225000% 22-17.05.32	CHF	47 000 000	47 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-17.05.32	CHF	47 000 000	47 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP PAY 0.740000% 22-18.05.27	CHF	88 000 000	88 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-18.05.27	CHF	88 000 000	88 000 000

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	136 453 726,07	6,31%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	–	–
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

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

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

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

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 3% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 3% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Umrechnungskurs

EUR 1 = CHF 1.026847

UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)

Art Effektenfonds

Dreijahresvergleich

	ISIN	31.5.2022	31.5.2021	31.5.2020
Nettofondsvermögen in CHF		70 946 389.28	91 719 769.89	105 857 563.27
Klasse P	CH0002788526			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		67.40	75.78	78.28
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		67.35	75.95	78.54
Anzahl Anteile im Umlauf		1 011 127,4810	1 161 335,3510	1 320 372,0690
Klasse Q	CH0203279556			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		87.77	98.68	101.91
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		87.70	98.91	102.25
Anzahl Anteile im Umlauf		31 813,1230	37 602,6350	24 542,0550

¹ siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2021/2022	2020/2021	2019/2020
Klasse P ¹	CHF	-10.4%	-2.2%	4.4%
Klasse Q ¹	CHF	-9.9%	-1.7%	5.0%

¹ Der Fonds verfügt (gemäß Fondsvertrag) über keine Benchmark daher erfolgt kein Vergleich der Fondsperformance mit einer Benchmark.

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

Bericht des Portfoliomanagers

Im Rechnungsjahr vom 1. Juni 2021 bis zum 31. Mai 2022 stiegen die Renditen von US-Treasuries deutlich an, da die Märkte angesichts der Anzeichen für eine hartnäckig hohe Inflation schnellere Zinserhöhungen der Fed erwarteten. In den USA stieg der Gesamt-Konsumentenpreisindex auf die höchsten Werte seit knapp 40 Jahren. Zunächst wurden die Preise durch die Freisetzung der aufgestauten Nachfrage und die fiskalpolitischen Stimulationsmassnahmen in die Höhe getrieben. Doch später wurde die Teuerung durch die hohen Rohstoffpreise infolge der anhaltenden russischen Invasion in der Ukraine verstärkt. Die US-Notenbank Fed hob ihren Leitzins von der effektiven Untergrenze auf 1,0% am Ende des Berichtszeitraums an.

Der Subfonds verbuchte im Rechnungsjahr einen negativen Gesamtertrag, der hauptsächlich auf die steigenden Staatsanleihenrenditen zurückzuführen war. Unser Engagement in den Kreditsektoren schlug negativ zu Buche, da sich die Kreditrisikoprämien ausweiteten. Unseres Erachtens werden die Renditen von Staatsanleihen aus Industrienationen im Jahr 2022 weiter steigen. Sie werden durch den Straffungszyklus der Fed und das weniger vorteilhafte Ungleichgewicht zwischen Nachfrage und Angebot in die Höhe getrieben, da die Zentralbanken von der quantitativen Lockerung auf eine quantitative Straffung umschwenken. Wir halten an unserer übergewichteten Duration in Neuseeland gegenüber Untergewichtungen in Grossbritannien und den USA fest. Innerhalb der Eurozone sind wir in Deutschland gegenüber Spanien untergewichtet und halten taktische Positionen in Italien gegenüber

Deutschland. Die wirtschaftlichen Fundamentaldaten sind für Investment-Grade-Anleihen immer noch vorteilhaft. Doch die geldpolitische Straffung und die geringere Liquiditätsunterstützung dürften zu einer leichten Ausweitung der Kreditrisikoprämien im Laufe des Jahres führen. Daher dürften sich später im Jahr Chancen zur Anhebung der Allokationen in Unternehmensanleihen und Anleihen staatlicher oder staatsnaher Organisationen (SSA) zu attraktiveren Bewertungen ergeben. Im Jahr 2022 wird dies aber kaum zu erheblichen Überschussrenditen beitragen. Neben Positionen in Agency-Papieren, supranationalen Anleihen und Investment-Grade-Unternehmensanleihen erkennen wir einzelne Chancen in Staats- und Unternehmensanleihen von Schwellenländern mit höheren Ratings.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten	19,27
Japan	19,01
Kanada	6,10
Italien	6,09
Grossbritannien	5,47
Frankreich	5,45
Spanien	3,82
Deutschland	3,03
Neuseeland	2,79
China	2,24
Übrige	19,45
Total	92,72

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	31.5.2022	31.5.2021
Verkehrswerte	CHF	CHF
Bankguthaben		
– auf Sicht	3 634 637.22	3 947 534.27
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	66 244 922.68	86 779 295.33
Derivative Finanzinstrumente	1 053 600.64	861 572.13
Sonstige Vermögenswerte	512 906.03	594 731.04
Gesamtfondsvermögen	71 446 066.57	92 183 132.77
Aufgenommene Kredite	-434 113.03	-421 264.22
Andere Verbindlichkeiten	-65 564.26	-42 098.66
Nettofondsvermögen	70 946 389.28	91 719 769.89

Erfolgsrechnung

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
Ertrag	CHF	CHF
Erträge der Bankguthaben	74.05	53.52
Negativzinsen	-7 414.38	-8 615.27
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	1 218 927.37	1 444 454.65
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	496 196.23	730 482.57
Erträge der Effektenleihe	19 759.89	30 610.17
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	2 169.44	18 654.23
Total Ertrag	1 729 712.60	2 215 639.87
Aufwand		
Passivzinsen	-1 417.27	-243.10
Prüfaufwand	-14 684.90	-14 684.90
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P	-909 954.88	-1 093 609.42
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q	-19 257.93	-20 888.75
Aufwand Teilnahme an Sammelklagen	-425.51	0.00
Sonstige Aufwendungen	-1 720.67	-1 692.92
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-53 546.48	-67 910.66
Total Aufwand	-1 001 007.64	-1 199 029.75
Nettoertrag	728 704.96	1 016 610.12
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	1 090 182.07	1 000 707.27
Realisierter Erfolg	1 818 887.03	2 017 317.39
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-10 022 797.95	-3 982 312.97
Gesamterfolg	-8 203 910.92	-1 964 995.58

Verwendung des Erfolges

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	728 704.96	1 016 610.12
Vortrag des Vorjahres	11 520.85	7 745.96
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	740 225.81	1 024 356.08
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-732 105.06	-1 012 835.23
Vortrag auf neue Rechnung	8 120.75	11 520.85

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

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	91 719 769.89	105 857 563.27
Ordentliche Jahresausschüttung	-977 055.48	-1 191 306.96
Saldo aus dem Anteilverkehr	-11 592 414.21	-10 981 490.84
Gesamterfolg	-8 203 910.92	-1 964 995.58
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	70 946 389.28	91 719 769.89

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2021-31.5.2022	1.6.2020-31.5.2021
Klasse P	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 161 335,3510	1 320 372,0690
Ausgegebene Anteile	7 826,8610	15 614,8430
Zurückgenommene Anteile	-158 034,7310	-174 651,5610
Bestand Ende Berichtsperiode	1 011 127,4810	1 161 335,3510
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-150 207,8700	-159 036,7180
Klasse Q	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	37 602,6350	24 542,0550
Ausgegebene Anteile	292,5770	27 095,9000
Zurückgenommene Anteile	-6 082,0890	-14 035,3200
Bestand Ende Berichtsperiode	31 813,1230	37 602,6350
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-5 789,5120	13 060,5800

Ausschüttung für 2021/2022

Klasse P

(Gegen Coupon Nr. 52- Ex-Datum 10.8.2022)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	0.68778
Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber brutto	CHF	0.68000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.23800
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.44200
Für nicht in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.68000

Klasse Q

(Gegen Coupon Nr. 7- Ex-Datum 10.8.2022)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	1.407
Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber brutto	CHF	1.400
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.490
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.910
Für nicht in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	1.400

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ²	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Notes, fester Zins

EUR

ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26*	EUR	100 000		100 000	90 012	0,13	
BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 4.00000% 12-28.03.32*	EUR	794 000		794 000	990 599	1,39	794 000
CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39*	EUR	195 000		195 000	160 188	0,22	
CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26*	EUR	250 000		250 000	242 613	0,34	
LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26*	EUR	100 000		100 000	96 264	0,13	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28*	EUR	100 000		100 000	93 453	0,13	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.37500% 20-11.02.31*	EUR	100 000		100 000	88 821	0,12	100 000
ROMANIA-REG-S 2.62500% 20-02.12.40*	EUR	370 000		370 000	254 270	0,36	160 000
SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28*	EUR	100 000		100 000	92 829	0,13	100 000
TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25*	EUR	130 000		130 000	118 306	0,17	
VONOVIA SE-REG-S 2.37500% 22-25.03.32*	EUR		100 000	100 000			
Total EUR					2 227 356	3,12	

USD

ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28*	USD	60 000		60 000	58 331	0,08	60 000
ABBVIE INC 4.87500% 18-14.11.48*	USD	50 000	50 000				
ADOBE INC 2.15000% 20-01.02.27*	USD	50 000		50 000	45 584	0,06	
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26*	USD		225 000	225 000	192 852	0,27	
AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52*	USD		220 000	220 000			
ALTRIA GROUP INC 4.40000% 19-14.02.26*	USD	26 000	26 000				
AMAZON.COM INC 3.45000% 22-13.04.29*	USD		105 000	105 000	100 027	0,14	
AMBER CIRCLE FUNDING LTD-REG-S 3.25000% 12-04.12.22*	USD	650 000		650 000	624 310	0,87	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.15000% 19-23.01.25*	USD	50 000	50 000				
ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29*	USD	65 000	65 000				
AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29*	USD	130 000	30 000	160 000	155 234	0,22	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.44000% 22-11.03.24*	USD		300 000	300 000			
BANK OF NOVA SCOTIA/THE 3.45000% 22-11.04.25*	USD	85 000		85 000	81 174	0,11	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.30000% 22-07.04.25*	USD	120 000		120 000	114 441	0,16	120 000
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.45000% 21-02.12.31*	USD		105 000	105 000	88 671	0,12	105 000
CHILE, REPUBLIC OF 3.86000% 17-21.06.47*	USD	200 000		200 000	169 040	0,24	
CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28*	USD	70 000	70 000				
CIGNA CORP 4.90000% 19-15.12.48*	USD	50 000		50 000	47 789	0,07	
CITIGROUP INC 4.65000% 18-23.07.48*	USD	120 000	120 000				
CNOOC PETROLEUM NORTH AMERICA ULC 6.40000% 07-15.05.37*	USD	160 000		160 000	170 227	0,24	
CNPC GENERAL CAPITAL LTD-REG-S 3.40000% 13-16.04.23*	USD	660 000	660 000				
COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25*	USD	60 000	60 000				
COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28*	USD	50 000	50 000				
COMCAST CORP 4.70000% 18-15.10.48*	USD	50 000	50 000				
COMCAST CORP 4.95000% 18-15.10.58*	USD	50 000	50 000				
CONAGRA BRANDS INC 5.40000% 18-01.11.48*	USD	50 000	50 000				
COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45*	USD	270 000		270 000	243 167	0,34	270 000
CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28*	USD	60 000	60 000				
DIAGEO CAPITAL PLC 2.12500% 19-24.10.24*	USD	320 000		320 000	298 941	0,42	
ENERGY TRANSFER LP 4.50000% 19-15.04.24*	USD	180 000	180 000				
EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27*	USD	110 000		110 000	101 633	0,14	
GEORGIA POWER CO 2.10000% 20-30.07.23*	USD	85 000		85 000	80 823	0,11	
INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42*	USD	420 000		420 000	414 115	0,58	220 000
OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48*	USD	280 000	280 000				
PETROLEOS MEXICANOS 6.84000% 20-23.01.30*	USD	190 000		190 000	163 001	0,23	
PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.45700% 20-05.05.30*	USD	260 000		260 000	224 017	0,31	260 000
PUBLIC STORAGE 1.95000% 21-09.11.28*	USD		70 000	70 000	59 549	0,08	
QATAR PETROLEUM-REG-S 2.25000% 21-12.07.31*	USD	200 000	200 000				
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.50000% 21-20.09.23*	USD	200 000	200 000				
RELANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52*	USD	280 000	280 000				
ROMANIA-REG-S 5.12500% 18-15.06.48*	USD	300 000		300 000	260 570	0,36	300 000
SINOPEC CAPITAL 2013 LTD-REG-S 3.12500% 13-24.04.23*	USD	680 000	680 000				
SPRINT CORP 7.87500% 14-15.09.23*	USD	150 000		150 000	150 612	0,21	
TELEFONICA EMISIONES SA 5.52000% 19-01.03.49*	USD	200 000		200 000	189 276	0,26	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.21500% 21-18.10.24*	USD	100 000	100 000				
TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36*	USD	420 000		420 000	329 948	0,46	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28*	USD	240 000		240 000	209 769	0,29	
VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24*	USD		80 000	80 000	72 601	0,10	
Total USD					5 141 476	7,20	

Total Notes, fester Zins

7 368 832 10,31

Notes, variabler Zins

EUR

BARCLAYS PLC-REG-S 0.577%VAR 21-09.08.29*	EUR		140 000	140 000	122 573	0,17	
CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.875%VAR 22-02.04.32*	EUR		100 000	100 000	94 394	0,13	100 000
Total EUR					216 968	0,30	

Total Notes, variabler Zins

216 968 0,30

Medium-Term Notes, fester Zins

AUD

CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.50000% 15-05.06.25*	AUD	200 000		200 000	137 210	0,19	
Total AUD					137 210	0,19	

EUR

AZA SPA-REG-S 1.50000% 22-16.03.28*	EUR		100 000	100 000	96 054	0,13	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA-REG-S 2.37500% 19-27.09.27*	EUR	100 000		100 000			
ASB FINANCE LTD-REG-S 0.25000% 21-08.09.28*	EUR		250 000	250 000	221 413	0,31	
ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29*	EUR	100 000		100 000	90 229	0,13	100 000
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMME-REG-S 0.37500% 22-10.03.26*	EUR		155 000	155 000	152 914	0,21	
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26*	EUR	170 000		170 000			
CREDIT SUISSE AG/LONDON-REG-S 0.25000% 21-05.01.26*	EUR	140 000		140 000	132 196	0,19	140 000
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.12500% 18-30.08.23*	EUR	255 000	255 000				
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23*	EUR	145 000		145 000	146 953	0,21	
E.ON SE-REG-S 1.62500% 22-29.03.31*	EUR		90 000	90 000			
ENGIE SA-REG-S 0.37500% 21-26.10.29*	EUR	200 000		200 000	176 491	0,25	200 000
EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.50000% 17-11.07.25*	EUR	400 000		400 000	404 480	0,57	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.37500% 18-16.07.25*	EUR	200 000		200 000	201 562	0,28	200 000
GAS NETWORKS IRELAND-REG-S 0.12500% 19-04.12.24*	EUR	100 000		100 000	98 887	0,14	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.62500% 16-27.07.26*	EUR	190 000			190 000	189 535	0,27	190 000
HOWOGE WOHNUNGS-BAUGESSELLSCHAFT-REG-S 0.62500% 21-01.11.28*	EUR		100 000		100 000	90 000	0,13	
KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24*	EUR	100 000			100 000	102 648	0,14	
KONINKLIJKE KPN NV-REG-S 0.87500% 21-15.11.33*	EUR		300 000	300 000				
LINDE PLC-REG-S 1.37500% 22-31.03.31*	EUR		200 000		200 000	188 891	0,26	200 000
LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.25000% 21-06.04.28*	EUR	115 000			115 000	105 212	0,15	65 000
LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.75000% 21-06.04.33*	EUR	100 000			100 000	84 828	0,12	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27*	EUR	190 000			190 000	179 624	0,25	190 000
P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26*	EUR		155 000		155 000	140 693	0,20	
POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49*	EUR	375 000			375 000	326 537	0,46	360 000
PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25*	EUR	150 000	100 000		250 000	242 644	0,34	
REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25*	EUR	200 000			200 000	209 173	0,29	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.62500% 22-23.03.26*	EUR		170 000		170 000	169 200	0,24	
RWE AG-REG-S 2.75000% 22-24.05.30*	EUR		175 000		175 000	178 753	0,25	
RYANAIR DAC-REG-S 0.87500% 21-25.05.26*	EUR		100 000	100 000				
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25*	EUR	100 000			100 000	101 085	0,14	100 000
TENNET HOLDING BV-REG-S 1.12500% 21-09.06.41*	EUR	145 000		145 000				
TENNET HOLDING BV-REG-S 0.87500% 21-16.06.35*	EUR		150 000		150 000	120 979	0,17	150 000
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG-REG-S 1.50000% 19-01.10.24*	EUR	95 000			95 000	96 994	0,14	95 000
Total EUR						4 247 974	5,95	
GBP								
CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 1.25000% 20-21.01.23*	GBP	130 000			130 000	155 906	0,22	120 000
Total GBP						155 906	0,22	
USD								
EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND-REG-S 1.45700% 20-15.10.25*	USD	305 000		305 000				
INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 2.80000% 21-10.02.31*	USD	225 000			225 000	178 826	0,25	
INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 20-03.04.25*	USD	330 000			330 000	299 921	0,42	
JOHN DEERE CAPITAL 2.12500% 22-07.03.25*	USD		80 000		80 000	74 886	0,10	
KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.95000% 20-10.08.25*	USD		200 000		200 000	49 845	0,07	
MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44*	USD	50 000		50 000				
PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49*	USD	200 000			200 000	172 515	0,24	200 000
RABOBANK UTRECHT 3.87500% 12-08.02.22*	USD	620 000		620 000				
SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29*	USD	200 000		200 000				
SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.00000% 18-17.04.25*	USD	200 000		200 000				
TORONTO-DOMINION BANK 2.35000% 22-08.03.24*	USD		225 000	225 000				
Total USD						775 993	1,09	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						5 317 083	7,44	
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
EUR								
CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28*	EUR	500 000			500 000	473 223	0,66	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 20-15.09.28*	EUR	565 000			565 000	534 875	0,75	565 000
NOVO NORDISK FINANCE NETHERLANDS BV 0.00000% 21-04.06.24*	EUR	105 000			105 000	105 351	0,15	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 0.00000% 20-20.02.23*	EUR	200 000			200 000	205 246	0,29	
STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26*	EUR		100 000		100 000	93 627	0,13	
Total EUR						1 412 322	1,98	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon						1 412 322	1,98	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
EUR								
BANK OF AMERICA CO-REG-S 1.379%/3M EURIBOR+103BP 17-07.02.25*	EUR	175 000			175 000	179 079	0,25	
BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 1.875%/VAR 22-05.06.26*	EUR		100 000		100 000	100 158	0,14	
CITIGROUP INC-REG-S 1.500%/VAR 18-24.07.26*	EUR	250 000			250 000	251 917	0,35	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25*	EUR	100 000			100 000	98 759	0,14	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.750%/VAR 20-19.11.30*	EUR	100 000			100 000	89 938	0,13	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 1.090%/VAR 19-11.03.27*	EUR	175 000		175 000				
NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 18-04.03.25*	EUR	100 000			100 000	102 850	0,14	
NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 1.000%/VAR 19-27.06.29*	EUR	100 000		100 000				
TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP*	EUR		200 000		200 000	200 806	0,28	200 000
VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 0.000%/VAR 21-27.05.24*	EUR	100 000			100 000	101 425	0,14	
Total EUR						1 124 931	1,57	
USD								
BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26*	USD	150 000			150 000	141 661	0,20	
Total USD						141 661	0,20	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						1 266 592	1,77	
Anleihen, fester Zins								
AUD								
AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37*	AUD	1 100 000			1 100 000	772 148	1,08	
Total AUD						772 148	1,08	
CAD								
CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 15-01.06.26*	CAD	2 910 000			2 910 000	2 106 896	2,95	
CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 19-01.09.24*	CAD	1 630 000			1 630 000	1 204 833	1,69	1 630 000
CANADA, GOVERNMENT 4.00000% 08-01.06.41*	CAD	505 000			505 000	439 180	0,61	505 000
Total CAD						3 750 909	5,25	
CNY								
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.30000% 21-03.03.26*	CNY		2 000 000		2 000 000	294 108	0,41	
Total CNY						294 108	0,41	
DKK								
DENMARK, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.50000% 19-15.11.29*	DKK	2 400 000			2 400 000	311 147	0,44	
Total DKK						311 147	0,44	
EUR								
ABBOTT IRELAND FINING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23*	EUR	125 000			125 000	128 601	0,18	
ABBVIE INC 1.37500% 16-17.05.24*	EUR	175 000		175 000				
ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23*	EUR		200 000		200 000	164 295	0,23	
ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26*	EUR	200 000		200 000				
BPCE SA-REG-S 0.25000% 20-15.01.26*	EUR	100 000			100 000	96 880	0,14	
CELANESE US HOLDINGS LLC 0.62500% 21-10.09.28*	EUR		100 000	100 000				
EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40*	EUR	235 000			235 000	171 195	0,24	235 000
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.25000% 07-25.10.23*	EUR	600 000		600 000				

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.50000% 10-25.04.26*	EUR	415 000			415 000	468 317	0,66	49 000
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.75000% 12-25.10.27*	EUR	1 240 000		1 040 000	200 000	222 951	0,31	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.25000% 15-25.05.36*	EUR	100 000			100 000	94 545	0,13	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 17-25.06.39*	EUR	593 000			593 000	594 332	0,83	593 000
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50*	EUR	475 000			475 000	421 991	0,59	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 19-25.05.29*	EUR		400 000		400 000	389 112	0,54	400 000
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 20-25.05.40*	EUR	600 000			600 000	474 609	0,66	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 17-15.08.27*	EUR		200 000		200 000	201 659	0,28	200 000
GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 98-04.07.28*	EUR	130 000			130 000	164 024	0,23	
INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24*	EUR	235 000			235 000	232 057	0,32	100 000
IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 15-18.02.45*	EUR	760 000			760 000	767 233	1,07	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 3.75000% 14-01.09.24*	EUR	400 000			400 000	432 429	0,61	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46*	EUR	1 035 000			1 035 000	1 044 409	1,46	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.65000% 15-01.03.32*	EUR	1 268 000			1 268 000	1 150 669	1,61	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 1.60000% 16-01.06.26*	EUR	970 000			970 000	980 931	1,37	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 0.95000% 16-15.03.23*	EUR	500 000		500 000				
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 3.00000% 19-01.08.29*	EUR	615 000			615 000	644 934	0,90	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 0.95000% 21-01.12.31*	EUR		835 000	835 000				
ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 0.90000% 20-01.04.31*	EUR	1 000 000		1 000 000				
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25*	EUR	175 000			175 000	175 709	0,25	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 5.50000% 98-15.01.28*	EUR	541 000			541 000	690 308	0,97	541 000
SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45*	EUR	445 000			445 000	512 918	0,72	170 000
SPAIN, KINGDOM OF 4.20000% 05-31.01.37*	EUR	108 000			108 000	134 518	0,19	
SPAIN, KINGDOM OF-144A 5.15000% 13-31.10.28*	EUR	600 000			600 000	745 065	1,04	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 5.15000% 13-31.10.44*	EUR	300 000		100 000	200 000	291 394	0,41	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.15000% 15-31.10.25*	EUR	946 000			946 000	1 003 484	1,40	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.45000% 16-30.07.66*	EUR	150 000			150 000	164 818	0,23	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35*	EUR	212 000			212 000	202 958	0,28	
Total EUR						12 766 342	17,86	
GBP								
DERWENT LONDON PLC-REG-S 1.87500% 21-17.11.31*	GBP		185 000		185 000	189 246	0,26	
UNITED KINGDOM GILT-REG-S 0.25000% 20-31.07.31*	GBP		80 000	80 000				
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 06-07.12.27*	GBP	141 000			141 000	192 606	0,27	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.47*	GBP	1 450 000		450 000	1 000 000	997 480	1,40	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.50000% 14-22.01.45*	GBP	650 000			650 000	927 242	1,30	
Total GBP						2 306 573	3,23	
JPY								
DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 2.30000% 06-19.03.26*	JPY	280 000 000			280 000 000	2 253 698	3,15	
JAPAN 0.10000% 18-20.03.23*	JPY	108 000 000		108 000 000				
JAPAN 0.10000% 18-20.03.28*	JPY	30 000 000			30 000 000	224 137	0,31	
JAPAN 0.10000% 19-20.12.28*	JPY		58 000 000		58 000 000	432 036	0,60	
JAPAN 0.10000% 21-20.03.31*	JPY		120 000 000	75 000 000	45 000 000	332 132	0,46	
JAPAN 0.30000% 16-20.06.46*	JPY	170 000 000			50 000 000	120 000 000	781 179	1,09
JAPAN 0.50000% 19-20.03.59*	JPY	72 000 000			72 000 000			
JAPAN 0.80000% 18-20.03.58*	JPY		15 000 000	15 000 000				
JAPAN 1.10000% 03-20.03.33*	JPY	791 000 000			791 000 000	6 385 858	8,94	
JAPAN 1.20000% 14-20.12.34*	JPY	218 550 000			218 550 000	1 785 800	2,50	
JAPAN 1.70000% 13-20.12.43*	JPY	148 000 000			148 000 000	1 294 924	1,81	
Total JPY						13 489 764	18,88	
MXN								
MEXICO, UNITED MEXICAN STATES 7.75000% 11-13.11.42*	MXN	272 400		43 000	229 400	1 002 835	1,40	
Total MXN						1 002 835	1,40	
NZD								
NEW ZEALAND 3.00000% 18-20.04.29*	NZD	400 000			400 000	241 576	0,34	
NEW ZEALAND-REG-S 2.75000% 16-15.04.37*	NZD		1 500 000		1 500 000	820 596	1,15	
Total NZD						1 062 172	1,49	
SEK								
SWEDEN, KINGDOM OF 3.50000% 09-30.03.39*	SEK	750 000			750 000	93 560	0,13	
SWEDEN, KINGDOM OF 3.50000% 10-01.06.22*	SEK	1 300 000			1 300 000	127 367	0,18	1 300 000
Total SEK						220 927	0,31	
USD								
ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 19-30.09.29*	USD	400 000			400 000	363 961	0,51	400 000
BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37*	USD	420 000			420 000	435 377	0,61	
COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41*	USD	410 000			410 000	355 989	0,50	
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 7.28800% 07-16.08.37*	USD	200 000		200 000				
HCA INC 5.37500% 15-01.02.25*	USD	80 000			80 000	79 267	0,11	
PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31*	USD	40 000			40 000	33 868	0,05	40 000
PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33*	USD	140 000			140 000	177 585	0,25	
SEAZEN GROUP LTD-REG-S 4.45000% 21-13.07.25*	USD		200 000		200 000	113 109	0,16	
URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50*	USD	300 000			300 000	306 311	0,43	300 000
Total USD						1 865 467	2,61	
Total Anleihen, fester Zins						37 939 360	53,10	
Anleihen, Nullcoupon								
EUR								
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.31*	EUR		240 000		240 000	223 190	0,31	240 000
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE 0.00000% 21-18.11.25*	EUR		100 000		100 000	96 967	0,14	
Total EUR						320 157	0,45	
Total Anleihen, Nullcoupon						320 157	0,45	
Anleihen, variabler Zins								
EUR								
HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.2500%/VAR 14-PRP*	EUR	310 000			310 000	319 034	0,45	
Total EUR						319 034	0,45	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GBP								
M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51*	GBP	110 000			110 000	135 669	0,19	25 000
SANTANDER UK GROUP HOLD PLC-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP*	GBP	200 000			200 000	243 062	0,34	200 000
Total GBP						378 731	0,53	
JPY								
JAPAN 0.100%/CPI LINKED 19-10.03.29*	JPY	350 000 000		350 000 000				
Total JPY							0,00	
NZD								
NEW ZEALAND-REG-S 2.500%/CPI LINKED 14-20.09.35*	NZD	1 110 000		1 110 000				
Total NZD							0,00	
Total Anleihen, variabler Zins						697 765	0,98	
Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39*	USD	3 100 500			3 100 500	3 145 427	4,40	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 12-15.08.42*	USD	1 709 000			1 709 000	1 497 382	2,10	1 709 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 15-15.02.45*	USD	685 000			685 000	566 734	0,79	685 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 16-15.05.46*	USD	46 000			46 000	38 061	0,05	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 16-15.08.46*	USD	1 505 000			1 505 000	1 183 736	1,66	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.08.47*	USD	955 000		590 000	365 000	318 000	0,45	365 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 19-15.05.49*	USD	900 000			900 000	813 629	1,14	900 000
AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 20-15.05.50*	USD	250 000			250 000	154 547	0,22	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 20-15.08.40*	USD		300 000		300 000	202 554	0,28	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 21-15.05.51*	USD		170 000		170 000	139 733	0,20	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 17-15.08.27*	USD	400 000		400 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 14-15.11.24*	USD	1 000 000		1 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23*	USD	250 000		250 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 14-15.05.24*	USD	1 160 000		1 160 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-30.11.26*	USD	1 000 000			1 000 000	910 548	1,27	1 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30*	USD	960 000	540 000		1 500 000	1 204 740	1,69	1 500 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-30.09.27*	USD		400 000		400 000	336 751	0,47	400 000
AMERICA, UNITED STATES OF TIGER STRIP 0.50000% 21-28.02.26*	USD	600 000			600 000	528 041	0,74	
Total USD						11 039 883	15,45	
Total Treasury-Notes, fester Zins						11 039 883	15,45	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						65 481 995	91,65	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

USD

CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26*	USD	120 000		64 000	56 000	53 727	0,08	
COMCAST CORP-144A 2.93700% 21-01.11.56*	USD		67 907	67 907				
DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 7.12500% 16-15.06.24*	USD	70 000			70 000			
MAGALLANES INC-144A 3.75500% 22-15.03.27*	USD		300 000	300 000				
TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24*	USD		120 000	120 000				
Total USD						53 727	0,08	

Total Notes, fester Zins

53 727 0,08

Anleihen, variabler Zins

NZD

NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40*	NZD	360 000			360 000	278 771	0,39	
NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30*	NZD	1 130 000		600 000	530 000	430 430	0,60	
Total NZD						709 201	0,99	

Total Anleihen, variabler Zins

709 201 0,99

Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

762 928 1,07

Total Wertschriften

66 244 923 92,72

(davon ausgeliehen

16 502 334 23,10)

Bankguthaben auf Sicht						3 634 637	5,09	
Derivative Finanzinstrumente						1 053 600	1,47	
Sonstige Vermögenswerte						512 906	0,72	
Gesamtfondsvermögen						71 446 066	100,00	

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-434 113		
Andere Verbindlichkeiten						-65 564		
Nettofondsvermögen						70 946 389		

Bewertungskategorie

	Verkehrswert per 31.5.2022	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	66 824 777	93,53
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	473 746	0,66
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	67 298 523	94,19

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 08.06.22*	-8	EUR	-1 245 113	47 564	0.07
EURO-BOBL FUTURE 08.06.22*	-8	EUR	-1 039 087	51 753	0.07
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.22*	-11	EUR	-1 243 840	18 750	0.03
EURO-BUXL FUTURE 08.06.22*	-12	EUR	-1 998 654	485 493	0.68
EURO-OAT FUTURE 08.06.22*	-4	EUR	-591 833	36 166	0.05
LONG GILT FUTURE 28.09.22*	-4	GBP	-560 395	8 553	0.01
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.22*	-6	JPY	-6 690 365	31 146	0.04
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.09.22*	-11	USD	-1 642 236	31 662	0.04
US LONG BOND FUTURE 21.09.22*	-16	USD	-2 138 525	27 963	0.04
CAN 10YR BOND FUTURE 20.09.22*	-11	CAD	-1 058 782	13 170	0.02
			-18 208 830	752 220	1.05

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.06.22*	5	EUR	651 380	-90 054	-0.13
AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.06.22*	14	AUD	1 046 949	-27 772	-0.04
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22*	32	USD	3 464 679	-16 190	-0.02
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.09.22*	4	USD	492 635	-5 362	-0.01
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.09.22*	30	USD	3 435 054	-27 146	-0.04
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22*	20	USD	4 047 028	-5 842	0.00
			13 137 725	-172 366	-0.24

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
CNY	2 280 000	USD	346 794	06.06.2022	4 176	0.01
USD	77 521	MYR	339 000	07.06.2022	-118	0.00
USD	346 630	KRW	441 000 000	07.06.2022	8 991	0.01
JPY	1 900 700 000	CHF	14 151 721	07.06.2022	-10 073	-0.01
USD	232 585	CLP	201 300 000	06.06.2022	11 433	0.02
USD	22 865 000	CHF	22 338 851	07.06.2022	423 931	0.59
CHF	40 549	SEK	410 000	07.06.2022	-381	0.00
GBP	2 645 000	CHF	3 237 946	07.06.2022	42 980	0.06
DKK	2 490 000	CHF	343 745	07.06.2022	77	0.00
AUD	1 400 000	CHF	970 875	07.06.2022	8 286	0.01
CAD	5 335 000	CHF	4 047 148	07.06.2022	4 630	0.01
NZD	2 935 000	CHF	1 840 621	07.06.2022	9 570	0.01
MXN	23 470 000	CHF	1 114 825	07.06.2022	-25 768	-0.04
EUR	23 560 000	CHF	24 199 466	07.06.2022	7 228	0.01
CHF	74 222	MXN	1 560 000	07.06.2022	1 591	0.00
CHF	131 726	USD	135 000	07.06.2022	-2 335	0.00
CHF	159 686	EUR	155 000	07.06.2022	-526	0.00
CHF	52 456	AUD	75 000	07.06.2022	-889	0.00
CHF	269 124	USD	275 000	07.06.2022	-5 551	-0.01
USD	40 748	CHF	40 000	07.06.2022	945	0.00
USD	74 397	GBP	60 000	07.06.2022	1 170	0.00
SEK	1 461 996	EUR	140 000	07.06.2022	526	0.00
CHF	177 212	USD	180 000	07.06.2022	-4 691	-0.01
CHF	83 349	EUR	80 000	07.06.2022	-1 202	0.00
USD	147 382	AUD	210 000	07.06.2022	3 131	0.00
CHF	162 220	EUR	155 000	07.06.2022	-3 061	0.00
CHF	163 826	USD	165 000	07.06.2022	-5 682	-0.01
CHF	99 073	USD	100 000	07.06.2022	-3 229	0.00
USD	70 000	ZAR	1 126 510	06.06.2022	2 182	0.00
EUR	115 000	CHF	120 054	07.06.2022	1 968	0.00
CHF	187 868	USD	190 000	07.06.2022	-5 763	-0.01
EUR	80 000	CHF	83 118	07.06.2022	971	0.00
USD	175 000	CHF	174 358	07.06.2022	6 629	0.01
USD	180 000	CAD	235 182	06.06.2022	5 688	0.01
EUR	155 000	CHF	161 280	07.06.2022	2 121	0.00
CHF	60 220	USD	60 000	07.06.2022	-2 713	0.00
CHF	31 401	EUR	30 000	07.06.2022	-596	0.00
CHF	124 507	USD	125 000	07.06.2022	-4 701	-0.01
CHF	152 128	EUR	145 000	07.06.2022	-3 237	0.00
SEK	1 413 412	NOK	1 390 000	07.06.2022	3 248	0.00
USD	100 000	CHF	97 245	07.06.2022	1 400	0.00
USD	90 000	CHF	87 629	07.06.2022	1 368	0.00
USD	95 000	CHF	91 783	07.06.2022	730	0.00
CHF	57 771	USD	60 000	07.06.2022	-264	0.00
CHF	82 561	EUR	80 000	07.06.2022	-414	0.00
USD	180 000	CHF	173 041	07.06.2022	520	0.00
MXN	890 000	CHF	43 127	07.06.2022	-125	0.00
USD	85 000	CHF	81 626	07.06.2022	158	0.00
GBP	115 000	SEK	1 433 236	07.06.2022	1 502	0.00
AUD	205 000	USD	145 870	06.06.2022	-1 140	0.00
ZAR	1 095 986	USD	70 000	06.06.2022	-305	0.00
USD	339 791	CNY	2 280 000	06.06.2022	2 538	0.00
USD	351 955	KRW	441 000 000	06.07.2022	3 231	0.00
KRW	441 000 000	USD	352 026	07.06.2022	-3 823	-0.01
CNY	2 280 000	USD	338 842	06.07.2022	-2 672	0.00
CAD	184 627	USD	145 000	06.06.2022	-926	0.00
MYR	339 000	USD	77 610	07.06.2022	203	0.00
USD	77 599	MYR	339 000	06.07.2022	-260	0.00
EUR	77 456	CHF	80 000	07.06.2022	466	0.00
CLP	201 300 000	USD	243 116	06.06.2022	-1 339	0.00
USD	241 758	CLP	201 300 000	06.07.2022	1 165	0.00

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
GBP	2 700 000	CHF	3 261 932	06.07.2022	6 124	0.01
CHF	3 266 730	GBP	2 700 000	07.06.2022	-5 328	0.00
CHF	15 422	EUR	15 000	07.06.2022	-19	0.01
					473 746	0.66

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 08.06.22	EUR	0	8
EURO-BOBL FUTURE 08.06.22	EUR	0	8
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.22	EUR	0	11
EURO-BUXL FUTURE 08.06.22	EUR	1	13
EURO-OAT FUTURE 08.06.22	EUR	0	4
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.09.21	EUR	11	11
EURO-BUND FUTURE 08.09.21	EUR	6	6
EURO-BOBL FUTURE 08.09.21	EUR	8	8
EURO-BUXL FUTURE 08.09.21	EUR	11	11
EURO-OAT FUTURE 08.09.21	EUR	2	2
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.12.21	EUR	9	9
EURO-BOBL FUTURE 08.12.21	EUR	8	8
EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.21	EUR	25	25
EURO-BUXL FUTURE 08.12.21	EUR	12	12
EURO-OAT FUTURE 08.12.21	EUR	2	2
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.06.21	EUR	8	0
EURO-BUND FUTURE 08.06.21	EUR	6	0
EURO-BUXL FUTURE 08.06.21	EUR	11	0
EURO-OAT FUTURE 08.06.21	EUR	5	0
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.03.22	EUR	10	10
EURO-BUND FUTURE 08.03.22	EUR	3	3
EURO-BOBL FUTURE 08.03.22	EUR	8	8
EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.22	EUR	25	25
EURO-BUXL FUTURE 08.03.22	EUR	13	13
EURO-OAT FUTURE 08.03.22	EUR	2	2
LONG GILT FUTURE 28.09.21	GBP	7	0
LONG GILT FUTURE 29.12.21	GBP	7	7
LONG GILT FUTURE 29.03.22	GBP	7	7
LONG GILT FUTURE 28.06.22	GBP	4	4
LONG GILT FUTURE 28.09.22	GBP	0	4
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 14.06.21	JPY	6	0
US LONG BOND FUTURE 21.09.21	USD	9	5
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.09.21	USD	14	11
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.09.21	USD	14	9
CAN 10YR BOND FUTURE 20.09.21	CAD	12	11
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.09.21	JPY	6	6
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.21	JPY	6	6
CAN 10YR BOND FUTURE 20.12.21	CAD	12	12
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.21	USD	16	16
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.12.21	USD	14	14
US LONG BOND FUTURE 21.12.21	USD	13	13
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.22	USD	9	9
CAN 10YR BOND FUTURE 22.03.22	CAD	22	22
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 14.03.22	JPY	6	6
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.22	USD	15	15
US LONG BOND FUTURE 22.03.22	USD	13	13
US LONG BOND FUTURE 21.06.22	USD	16	16
CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.22	CAD	22	22
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.22	USD	6	6
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.22	USD	14	14
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.22	JPY	2	8
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.09.22	USD	0	11
US LONG BOND FUTURE 21.09.22	USD	0	16
CAN 10YR BOND FUTURE 20.09.22	CAD	0	11

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.06.22	EUR	5	0
EURO-BUND FUTURE 08.09.21	EUR	2	2
EURO-OAT FUTURE 08.09.21	EUR	0	3
EURO-BUND FUTURE 08.12.21	EUR	5	5
EURO-BOBL FUTURE 08.06.21	EUR	0	10
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.03.22	EUR	5	5
LONG GILT FUTURE 29.03.22	GBP	4	4
LONG GILT FUTURE 28.06.22	GBP	6	6
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.09.21	USD	24	30
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.21	USD	0	68
AUSTRALIAN 3YR BOND FUTURE 15.12.21	AUD	30	30
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.21	USD	38	38
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.21	USD	68	68
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.21	USD	37	37
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.22	USD	38	38
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	USD	37	37
AUSTRALIAN 3YR BOND FUTURE 15.03.22	AUD	14	14
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	USD	20	20
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.22	USD	38	38
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	USD	20	20
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	USD	37	37
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.22	USD	4	4
AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.06.22	AUD	14	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22	USD	32	0
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.09.22	USD	4	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.09.22	USD	30	0
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22	USD	20	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
JPY	19 484 802	NOK	1 470 000	04.06.2021
PLN	1 340 000	CHF	329 118	04.06.2021
CHF	328 909	PLN	1 340 000	06.07.2021
CHF	159 027	NOK	1 470 000	06.07.2021
SEK	5 840 000	CHF	635 413	06.07.2021
JPY	2 328 900 000	CHF	19 112 883	06.07.2021
AUD	4 400 000	CHF	3 061 498	06.07.2021
GBP	3 440 000	CHF	4 382 334	06.07.2021
EUR	26 890 000	CHF	29 515 462	06.07.2021
NZD	4 345 000	CHF	2 826 163	06.07.2021
MXN	21 490 000	CHF	965 204	06.07.2021
CAD	6 740 000	CHF	5 026 877	06.07.2021
DKK	2 490 000	CHF	367 386	06.07.2021
USD	28 165 000	CHF	25 368 863	06.07.2021
CAD	208 949	AUD	225 000	06.07.2021
EUR	145 000	NOK	1 475 345	06.07.2021
USD	125 000	CHF	112 231	06.07.2021
CAD	215 000	SEK	1 471 691	06.07.2021
EUR	165 000	NOK	1 664 395	06.07.2021
USD	177 697	AUD	230 000	06.07.2021
EUR	115 000	CHF	125 499	06.07.2021
CAD	225 000	CHF	166 735	06.07.2021
USD	204 417	NZD	285 000	06.07.2021
USD	62 254	NOK	520 000	06.07.2021
USD	41 771	PLN	155 000	06.07.2021
JPY	10 100 000	CHF	82 632	06.07.2021
CHF	94 409	USD	105 000	06.07.2021
USD	202 374	NZD	285 000	06.07.2021
AUD	225 000	NZD	242 909	06.07.2021
USD	91 800	MXN	1 908 063	06.07.2021
JPY	18 992 992	CAD	215 000	06.07.2021
USD	65 493	EUR	55 000	06.07.2021
USD	130 428	CHF	120 000	06.07.2021
SEK	1 718 938	NOK	1 730 000	06.07.2021
USD	108 200	MXN	2 234 027	06.07.2021
MXN	3 859 898	GBP	140 000	06.07.2021
SEK	1 680 605	NOK	1 690 000	06.07.2021
CHF	98 682	EUR	90 000	06.07.2021
EUR	100 000	CHF	109 652	06.07.2021
USD	100 000	CHF	92 466	06.07.2021
USD	29 270 000	CHF	27 075 204	05.08.2021
CHF	913 468	NOK	8 550 000	05.08.2021
SEK	7 770 000	CHF	836 409	05.08.2021
USD	100 000	CHF	92 537	05.08.2021
CHF	361 713	PLN	1 495 000	05.08.2021
AUD	4 170 000	CHF	2 875 890	05.08.2021
MXN	21 210 000	CHF	979 178	05.08.2021
GBP	3 300 000	CHF	4 200 123	05.08.2021
CAD	7 175 000	CHF	5 339 732	05.08.2021
JPY	2 358 000 000	CHF	19 578 678	05.08.2021
DKK	2 490 000	CHF	366 747	05.08.2021
EUR	27 270 000	CHF	29 868 062	05.08.2021
NZD	3 535 000	CHF	2 275 771	05.08.2021
MXN	3 909 263	USD	195 000	05.08.2021
CHF	1 092 470	AUD	1 575 000	05.08.2021
CHF	922 338	AUD	1 320 000	05.08.2021
GBP	70 000	CHF	89 319	05.08.2021
EUR	130 000	CHF	141 895	05.08.2021
USD	156 000	CHF	143 876	05.08.2021
JPY	21 182 607	NOK	1 690 000	05.08.2021
USD	110 000	CHF	100 800	05.08.2021
MXN	3 921 845	CAD	245 000	05.08.2021
CHF	265 288	USD	290 000	05.08.2021
EUR	165 000	PLN	754 615	05.08.2021
CHF	170 000	USD	185 480	05.08.2021
USD	135 000	CHF	124 154	05.08.2021
CHF	113 924	EUR	105 000	05.08.2021
USD	191 972	AUD	260 000	05.08.2021
USD	195 000	CAD	246 577	05.08.2021
GBP	85 000	CHF	106 452	05.08.2021
USD	215 000	CHF	198 050	05.08.2021
USD	195 000	KRW	225 381 000	05.08.2021
CHF	140 000	USD	151 888	05.08.2021
EUR	135 000	CHF	146 299	05.08.2021
CHF	105 000	USD	114 447	05.08.2021
CHF	221 619	EUR	205 000	05.08.2021
CHF	177 950	EUR	165 000	05.08.2021
KRW	225 381 000	USD	196 788	05.08.2021
CAD	200 000	EUR	135 348	05.08.2021
NZD	130 000	CHF	82 420	05.08.2021
CHF	48 438	EUR	45 000	05.08.2021
USD	200 000	THB	6 578 360	07.09.2021
USD	197 228	KRW	226 000 000	07.09.2021
JPY	2 379 200 000	CHF	19 702 156	07.09.2021
AUD	1 015 000	CHF	677 583	07.09.2021
SEK	7 770 000	CHF	818 496	07.09.2021
CHF	530 904	PLN	2 250 000	07.09.2021
CHF	1 053 776	NOK	10 240 000	07.09.2021
GBP	3 455 000	CHF	4 343 874	07.09.2021
EUR	27 045 000	CHF	29 057 351	07.09.2021
CAD	6 885 000	CHF	4 970 259	07.09.2021
NZD	3 665 000	CHF	2 317 878	07.09.2021
MXN	29 050 000	CHF	1 318 061	07.09.2021
DKK	2 490 000	CHF	359 619	07.09.2021
USD	29 435 000	CHF	26 600 380	07.09.2021
USD	110 000	CHF	99 221	07.09.2021
THB	6 656 100	USD	200 000	07.09.2021
AUD	265 000	USD	196 278	07.09.2021
USD	305 000	CHF	276 321	07.09.2021
EUR	100 000	CHF	107 293	07.09.2021
USD	215 000	CHF	197 025	07.09.2021
CHF	96 751	USD	105 000	07.09.2021
CHF	547 206	EUR	505 000	07.09.2021

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
USD	100 000	CHF	91 365	07.09.2021
EUR	165 000	NZD	281 808	07.09.2021
USD	195 000	CAD	250 285	07.09.2021
USD	135 000	CHF	123 848	07.09.2021
CHF	161 843	EUR	150 000	07.09.2021
CAD	247 399	USD	195 000	07.09.2021
NOK	1 700 000	JPY	21 594 932	07.09.2021
KRW	226 000 000	USD	195 400	07.09.2021
JPY	21 242 720	GBP	140 000	07.09.2021
USD	195 333	KRW	226 000 000	06.10.2021
CAD	6 885 000	CHF	5 000 406	06.10.2021
USD	30 005 000	CHF	27 464 723	06.10.2021
NZD	275 135	EUR	165 000	06.10.2021
MXN	29 050 000	CHF	1 324 307	06.10.2021
DKK	2 490 000	CHF	363 389	06.10.2021
CHF	540 871	PLN	2 250 000	06.10.2021
JPY	2 378 900 000	CHF	19 755 611	06.10.2021
CHF	901 821	NOK	8 540 000	06.10.2021
SEK	7 770 000	CHF	828 274	06.10.2021
AUD	1 280 000	CHF	869 304	06.10.2021
GBP	3 315 000	CHF	4 188 857	06.10.2021
NZD	3 385 000	CHF	2 203 377	06.10.2021
EUR	26 655 000	CHF	28 935 042	06.10.2021
CHF	1 168 238	EUR	1 075 000	06.10.2021
EUR	160 944	CHF	175 000	06.10.2021
NZD	280 000	CAD	250 313	06.10.2021
NOK	1 647 633	EUR	160 000	06.10.2021
CHF	119 617	USD	130 000	06.10.2021
NZD	274 703	AUD	265 000	06.10.2021
CHF	254 143	JPY	30 400 000	06.10.2021
USD	120 000	CHF	109 936	06.10.2021
JPY	20 752 592	PLN	730 000	06.10.2021
CHF	81 643	EUR	75 000	06.10.2021
CHF	82 487	GBP	65 000	06.10.2021
AUD	260 000	CAD	240 965	06.10.2021
NOK	1 650 000	EUR	163 702	06.10.2021
CHF	194 056	USD	210 000	06.10.2021
CHF	146 489	EUR	135 000	06.10.2021
CHF	92 701	USD	100 000	06.10.2021
KRW	226 000 000	USD	190 476	06.10.2021
CHF	172 358	CAD	235 000	06.10.2021
CHF	106 895	GBP	85 000	06.10.2021
CHF	54 235	EUR	50 000	06.10.2021
CHF	111 466	USD	120 000	06.10.2021
EUR	130 633	MXN	3 100 000	06.10.2021
CHF	137 338	AUD	205 000	06.10.2021
CHF	92 095	EUR	85 000	06.10.2021
CHF	186 576	USD	200 000	06.10.2021
CAD	233 935	USD	185 000	06.10.2021
KRW	226 000 000	USD	190 364	06.10.2021
USD	190 364	KRW	226 000 000	06.10.2021
NOK	1 620 000	SEK	1 633 534	06.10.2021
CHF	288 259	USD	310 000	06.10.2021
CNY	100 000	USD	15 495	08.10.2021
USD	15 468	CNY	100 000	08.10.2021
CNY	100 000	USD	15 465	08.10.2021
CNY	100 000	USD	15 413	04.11.2021
USD	190 377	KRW	226 000 000	04.11.2021
AUD	1 070 000	CHF	722 250	04.11.2021
JPY	2 369 300 000	CHF	19 758 910	04.11.2021
CHF	702 831	PLN	2 980 000	04.11.2021
CHF	391 147	NOK	3 630 000	04.11.2021
GBP	3 165 000	CHF	3 989 825	04.11.2021
CAD	6 395 000	CHF	4 699 965	04.11.2021
SEK	6 140 000	CHF	652 130	04.11.2021
MXN	25 950 000	CHF	1 165 012	04.11.2021
DKK	2 490 000	CHF	360 909	04.11.2021
NZD	4 215 000	CHF	2 722 880	04.11.2021
USD	28 875 000	CHF	26 784 017	04.11.2021
EUR	25 040 000	CHF	27 001 834	04.11.2021
CHF	340 000	EUR	315 875	04.11.2021
AUD	255 000	NZD	267 702	04.11.2021
CHF	236 422	USD	255 000	04.11.2021
CHF	139 233	EUR	130 000	04.11.2021
CHF	153 743	JPY	18 500 000	04.11.2021
NOK	1 590 000	SEK	1 627 352	04.11.2021
USD	185 000	MXN	3 856 767	04.11.2021
CHF	59 444	CAD	80 000	04.11.2021
CHF	148 275	USD	160 000	04.11.2021
AUD	243 444	EUR	155 000	04.11.2021
CHF	68 767	JPY	8 400 000	04.11.2021
CNY	1 040 000	USD	160 872	04.11.2021
CHF	170 895	EUR	160 000	04.11.2021
USD	210 000	CHF	193 234	04.11.2021
PLN	730 000	JPY	21 129 433	04.11.2021
GBP	70 000	CHF	89 011	04.11.2021
CHF	170 000	JPY	21 043 263	04.11.2021
CHF	96 984	USD	105 000	04.11.2021
CHF	252 217	USD	275 000	04.11.2021
MXN	3 752 125	USD	185 000	04.11.2021
EUR	185 000	USD	215 325	04.11.2021
CHF	150 000	USD	163 727	04.11.2021
NOK	1 550 000	SEK	1 597 867	04.11.2021
NZD	260 000	CAD	230 527	04.11.2021
CHF	85 453	EUR	80 000	04.11.2021
USD	75 314	NZD	105 000	04.11.2021
CHF	115 000	USD	125 340	04.11.2021
USD	178 236	CNY	1 140 000	04.11.2021
KRW	226 000 000	USD	193 129	04.11.2021
GBP	75 000	CHF	94 609	04.11.2021
USD	220 000	CHF	201 575	04.11.2021
CHF	1 143 929	MXN	25 845 358	04.11.2021
CHF	110 793	EUR	105 000	04.11.2021
CHF	95 758	USD	105 000	04.11.2021
EUR	160 000	CHF	168 909	04.11.2021
EUR	155 000	HUF	56 641 495	06.12.2021
USD	192 942	KRW	226 000 000	06.12.2021

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CNY	1 140 000	USD	177 695	06.12.2021
MXN	25 850 000	CHF	1 137 487	06.12.2021
JPY	2 300 300 000	CHF	18 407 077	06.12.2021
AUD	1 570 000	CHF	1 068 201	06.12.2021
CAD	6 085 000	CHF	4 470 611	06.12.2021
DKK	2 490 000	CHF	354 091	06.12.2021
SEK	2 920 000	CHF	311 859	06.12.2021
CHF	515 282	PLN	2 250 000	06.12.2021
CHF	866 626	JPY	108 000 000	06.12.2021
GBP	3 310 000	CHF	4 114 169	06.12.2021
NZD	4 105 000	CHF	2 669 865	06.12.2021
USD	27 980 000	CHF	25 516 249	06.12.2021
EUR	24 440 000	CHF	25 866 001	06.12.2021
EUR	930 000	CHF	984 167	06.12.2021
CHF	164 182	USD	180 000	06.12.2021
EUR	135 000	CHF	142 571	06.12.2021
CHF	91 265	USD	100 000	06.12.2021
HUF	55 880 058	EUR	155 000	06.12.2021
USD	180 000	CHF	164 755	06.12.2021
EUR	125 000	CHF	131 867	06.12.2021
SEK	1 592 347	NOK	1 590 000	06.12.2021
USD	90 000	MXN	1 842 833	06.12.2021
USD	140 000	CHF	128 037	06.12.2021
JPY	21 033 369	CHF	170 000	06.12.2021
GBP	90 000	CHF	110 838	06.12.2021
EUR	100 000	CHF	105 474	06.12.2021
USD	181 109	GBP	135 000	06.12.2021
NOK	1 600 000	SEK	1 607 333	06.12.2021
CHF	100 401	EUR	95 000	06.12.2021
CHF	156 631	USD	170 000	06.12.2021
CHF	80 309	GBP	65 000	06.12.2021
CNY	100 000	USD	15 656	06.12.2021
GBP	265 000	CHF	327 470	06.12.2021
CAD	227 684	EUR	160 000	06.12.2021
CHF	101 835	USD	110 000	06.12.2021
CHF	51 846	CAD	70 000	06.12.2021
CHF	89 511	EUR	85 000	06.12.2021
CHF	51 154	USD	55 000	06.12.2021
CNY	1 040 000	USD	162 581	06.12.2021
EUR	160 000	HUF	58 119 133	06.12.2021
USD	180 000	ZAR	2 828 929	06.12.2021
USD	185 000	CAD	233 748	06.12.2021
GBP	135 000	USD	181 093	06.12.2021
USD	120 000	CHF	111 229	06.12.2021
EUR	100 000	CHF	104 624	06.12.2021
USD	90 000	MXN	1 891 989	06.12.2021
EUR	160 000	CAD	228 261	06.12.2021
NOK	1 600 000	SEK	1 622 979	06.12.2021
CHF	183 648	EUR	175 000	06.12.2021
CHF	248 239	USD	265 000	06.12.2021
USD	45 064	MXN	970 000	06.12.2021
USD	180 000	KRW	214 498 980	06.12.2021
AUD	250 000	NZD	262 403	06.12.2021
MXN	1 940 772	USD	90 000	06.12.2021
MXN	1 938 587	USD	90 000	06.12.2021
ZAR	2 928 263	USD	180 000	06.12.2021
NOK	1 620 000	SEK	1 635 989	06.12.2021
USD	357 143	CNY	2 280 000	06.12.2021
KRW	440 498 980	USD	369 546	06.12.2021
USD	270 000	CHF	249 968	06.12.2021
USD	180 000	CAD	229 665	06.12.2021
EUR	160 000	CAD	232 080	06.12.2021
GBP	80 000	CHF	98 032	06.12.2021
USD	105 000	CHF	96 655	06.12.2021
EUR	125 000	CHF	130 247	06.12.2021
CNY	2 280 000	USD	356 111	07.01.2022
USD	369 827	KRW	441 000 000	07.01.2022
SEK	1 657 299	NOK	1 660 000	07.01.2022
GBP	3 680 000	CHF	4 497 190	07.01.2022
EUR	25 920 000	CHF	26 998 391	07.01.2022
NZD	3 845 000	CHF	2 399 623	07.01.2022
CAD	5 320 000	CHF	3 805 478	07.01.2022
MXN	25 030 000	CHF	1 069 737	07.01.2022
DKK	2 490 000	CHF	348 877	07.01.2022
CHF	507 814	PLN	2 250 000	07.01.2022
CHF	168 847	HUF	58 900 000	07.01.2022
NOK	3 230 000	CHF	326 414	07.01.2022
CHF	36 526	SEK	360 000	07.01.2022
JPY	2 213 400 000	CHF	18 006 218	07.01.2022
AUD	1 820 000	CHF	1 185 954	07.01.2022
USD	28 330 000	CHF	25 978 043	07.01.2022
USD	39 733	EUR	35 000	07.01.2022
CHF	170 000	SEK	1 689 902	07.01.2022
EUR	160 000	USD	180 698	07.01.2022
USD	182 477	AUD	260 000	07.01.2022
SEK	1 661 012	NOK	1 670 000	07.01.2022
JPY	6 200 000	CHF	50 493	07.01.2022
MXN	1 190 000	CHF	51 362	07.01.2022
USD	125 000	CHF	115 182	07.01.2022
EUR	75 000	USD	84 383	07.01.2022
CHF	281 359	USD	305 000	07.01.2022
USD	180 000	CAD	230 762	07.01.2022
EUR	95 000	CHF	98 831	07.01.2022
USD	175 000	CHF	160 772	07.01.2022
SEK	1 616 468	CHF	165 000	07.01.2022
JPY	6 100 000	USD	53 477	07.01.2022
CHF	184 602	GBP	150 000	07.01.2022
NZD	264 245	AUD	250 000	07.01.2022
CHF	220 000	EUR	211 344	07.01.2022
CHF	86 025	GBP	70 000	07.01.2022
KRW	441 000 000	USD	370 215	07.01.2022
USD	357 277	CNY	2 280 000	07.01.2022
AUD	255 000	USD	184 496	07.01.2022
CHF	286 241	EUR	275 000	07.01.2022
CHF	135 000	USD	146 976	07.01.2022
CHF	170 858	EUR	165 000	07.01.2022
CHF	205 537	USD	225 000	07.01.2022

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	162 500	SEK	1 672 965	07.01.2022
PLN	2 250 000	CHF	509 840	07.01.2022
CHF	146 768	USD	160 000	07.01.2022
CHF	281 438	USD	305 000	12.01.2022
USD	370 044	KRW	441 000 000	04.02.2022
SEK	1 220 000	CHF	122 949	04.02.2022
CHF	508 604	PLN	2 250 000	04.02.2022
DKK	2 490 000	CHF	346 758	04.02.2022
MXN	26 220 000	CHF	1 167 236	04.02.2022
CHF	168 143	HUF	58 900 000	04.02.2022
CAD	5 090 000	CHF	3 660 865	04.02.2022
JPY	2 225 700 000	CHF	17 598 449	04.02.2022
AUD	1 565 000	CHF	1 038 965	04.02.2022
GBP	3 460 000	CHF	4 287 298	04.02.2022
EUR	25 730 000	CHF	26 652 351	04.02.2022
NZD	4 110 000	CHF	2 563 629	04.02.2022
USD	27 695 000	CHF	25 343 833	04.02.2022
CHF	83 796	JPY	10 600 000	04.02.2022
CAD	230 122	USD	180 000	04.02.2022
CHF	142 317	USD	155 000	04.02.2022
USD	94 788	GBP	70 000	04.02.2022
USD	90 473	EUR	80 000	04.02.2022
USD	85 000	COP	343 910 000	04.02.2022
CHF	162 066	USD	175 000	04.02.2022
CHF	94 393	EUR	90 000	04.02.2022
EUR	160 000	USD	183 196	04.02.2022
PLN	704 345	EUR	155 000	04.02.2022
CAD	221 363	AUD	245 000	04.02.2022
GBP	130 000	SEK	1 604 563	04.02.2022
CHF	55 000	EUR	52 699	04.02.2022
CHF	178 255	USD	195 000	04.02.2022
CHF	237 817	USD	260 000	04.02.2022
CHF	88 238	EUR	85 000	04.02.2022
CHF	567 563	GBP	455 000	04.02.2022
CHF	506 095	NZD	815 000	04.02.2022
CAD	227 645	NZD	270 000	04.02.2022
USD	185 000	CHF	168 695	04.02.2022
USD	175 762	EUR	155 000	04.02.2022
USD	155 000	CHF	141 404	04.02.2022
KRW	441 000 000	USD	368 098	04.02.2022
HUF	55 674 140	EUR	155 000	04.02.2022
CHF	50 643	USD	55 000	04.02.2022
CHF	163 065	USD	175 000	04.02.2022
KRW	441 000 000	USD	365 763	04.02.2022
USD	365 763	KRW	441 000 000	04.02.2022
COP	343 910 000	USD	86 366	04.02.2022
EUR	150 000	PLN	689 718	04.02.2022
CHF	114 139	EUR	110 000	04.02.2022
CHF	72 314	JPY	9 000 000	04.02.2022
USD	170 000	SEK	1 577 585	04.02.2022
CNY	2 280 000	USD	356 078	07.02.2022
USD	360 133	CNY	2 280 000	07.02.2022
CNY	2 280 000	USD	359 724	07.02.2022
CNY	2 280 000	USD	359 168	04.03.2022
USD	367 797	KRW	441 000 000	04.03.2022
USD	86 120	COP	343 910 000	04.03.2022
CHF	196 703	SEK	1 970 000	04.03.2022
EUR	25 160 000	CHF	26 150 984	04.03.2022
JPY	2 206 100 000	CHF	17 717 671	04.03.2022
GBP	3 065 000	CHF	3 814 961	04.03.2022
AUD	1 320 000	CHF	866 716	04.03.2022
NZD	3 025 000	CHF	1 844 861	04.03.2022
DKK	2 490 000	CHF	347 974	04.03.2022
MXN	26 220 000	CHF	1 169 382	04.03.2022
CAD	5 770 000	CHF	4 177 133	04.03.2022
CHF	511 483	PLN	2 240 000	04.03.2022
USD	27 190 000	CHF	24 963 628	04.03.2022
USD	189 560	NZD	285 000	04.03.2022
CHF	313 561	EUR	300 000	04.03.2022
USD	169 658	GBP	125 000	04.03.2022
USD	435 000	CHF	399 701	04.03.2022
CHF	362 947	USD	395 000	04.03.2022
USD	85 000	CLP	69 827 500	04.03.2022
CHF	195 611	EUR	185 000	04.03.2022
USD	169 264	AUD	240 000	04.03.2022
CHF	263 007	USD	285 000	04.03.2022
CHF	174 300	EUR	165 000	04.03.2022
JPY	66 000 000	USD	573 571	04.03.2022
CHF	212 333	USD	230 000	04.03.2022
CHF	99 856	GBP	80 000	04.03.2022
CHF	71 241	JPY	8 900 000	04.03.2022
CHF	152 865	EUR	145 000	04.03.2022
CHF	189 216	USD	205 000	04.03.2022
EUR	175 000	USD	200 173	04.03.2022
EUR	155 000	SEK	1 639 111	04.03.2022
CHF	138 184	JPY	17 300 000	04.03.2022
CHF	153 026	EUR	145 000	04.03.2022
CHF	188 503	GBP	150 000	04.03.2022
CHF	157 388	USD	170 000	04.03.2022
USD	107 524	EUR	95 000	04.03.2022
CHF	143 035	USD	155 000	04.03.2022
EUR	160 000	USD	181 769	04.03.2022
USD	17 000	RUB	1 339 173	04.03.2022
RUB	1 339 173	USD	17 279	04.03.2022
CLP	69 827 500	USD	87 331	04.03.2022
USD	160 000	CHF	146 663	04.03.2022
CHF	79 891	MXN	1 770 000	04.03.2022
AUD	245 000	CAD	225 085	04.03.2022
GBP	125 000	USD	169 765	04.03.2022
NZD	250 000	USD	168 479	04.03.2022
NZD	250 000	CAD	214 385	04.03.2022
CHF	37 482	NZD	60 000	04.03.2022
KRW	441 000 000	USD	366 431	04.03.2022
AUD	230 000	USD	164 847	04.03.2022
JPY	9 600 000	USD	83 515	04.03.2022
CHF	325 000	USD	351 822	04.03.2022
GBP	85 000	USD	113 591	04.03.2022

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
AUD	150 000	USD	107 320	04.03.2022
USD	170 000	JPY	19 538 034	04.03.2022
COP	335 282 500	USD	85 000	04.03.2022
AUD	230 000	USD	165 310	04.03.2022
USD	360 874	CNY	2 280 000	04.03.2022
COP	8 627 500	USD	2 206	04.03.2022
CHF	125 098	USD	135 000	04.03.2022
SEK	1 565 283	EUR	147 500	04.03.2022
PLN	685 420	EUR	145 000	04.03.2022
USD	140 000	CHF	128 726	04.03.2022
CHF	166 526	EUR	165 000	10.03.2022
USD	366 206	KRW	441 000 000	06.04.2022
CNY	2 280 000	USD	359 848	06.04.2022
CHF	326 949	PLN	1 555 000	06.04.2022
EUR	24 325 000	CHF	24 797 635	06.04.2022
NZD	3 180 000	CHF	1 974 103	06.04.2022
CAD	5 335 000	CHF	3 855 194	06.04.2022
GBP	2 920 000	CHF	3 571 759	06.04.2022
USD	24 880 000	CHF	22 842 950	06.04.2022
AUD	1 935 000	CHF	1 290 869	06.04.2022
JPY	2 236 000 000	CHF	17 825 298	06.04.2022
DKK	2 490 000	CHF	341 419	06.04.2022
MXN	24 450 000	CHF	1 077 305	06.04.2022
CHF	193 897	SEK	2 050 000	06.04.2022
EUR	420 000	CHF	429 053	06.04.2022
GBP	120 000	CHF	147 290	06.04.2022
USD	195 000	CHF	179 399	06.04.2022
PLN	716 919	EUR	150 000	06.04.2022
JPY	15 200 000	CHF	120 756	06.04.2022
CHF	173 155	EUR	170 000	06.04.2022
CHF	371 760	USD	405 000	06.04.2022
SEK	1 592 493	EUR	147 500	06.04.2022
CHF	96 942	GBP	80 000	06.04.2022
USD	225 000	CHF	207 727	06.04.2022
EUR	165 000	CHF	166 501	06.04.2022
CHF	194 749	USD	210 000	06.04.2022
CHF	116 512	EUR	115 000	06.04.2022
CHF	78 544	MXN	1 790 000	06.04.2022
CHF	180 943	USD	195 000	06.04.2022
PLN	716 089	EUR	150 000	06.04.2022
CHF	91 549	GBP	75 000	06.04.2022
CHF	148 693	EUR	145 000	06.04.2022
CHF	186 152	USD	200 000	06.04.2022
CHF	220 204	EUR	215 000	06.04.2022
CHF	314 501	USD	335 000	06.04.2022
CHF	56 789	EUR	55 000	06.04.2022
CHF	49 344	JPY	6 200 000	06.04.2022
SEK	1 487 949	GBP	120 000	06.04.2022
EUR	90 000	CHF	92 439	06.04.2022
EUR	255 000	JPY	33 534 884	06.04.2022
USD	85 000	CHF	79 089	06.04.2022
CHF	80 292	GBP	65 000	06.04.2022
CHF	154 514	JPY	20 000 000	06.04.2022
CHF	251 568	USD	270 000	06.04.2022
CHF	144 803	USD	155 000	06.04.2022
CHF	84 346	NZD	130 000	06.04.2022
CHF	122 991	EUR	120 000	06.04.2022
USD	80 000	CLP	63 748 800	06.04.2022
USD	73 036	JPY	8 900 000	06.04.2022
USD	82 534	AUD	110 000	06.04.2022
CHF	2 582 977	JPY	339 000 000	06.04.2022
EUR	160 000	CHF	163 531	06.04.2022
USD	358 055	CNY	2 280 000	06.04.2022
CHF	280 268	USD	300 000	06.04.2022
KRW	441 000 000	USD	364 391	06.04.2022
USD	265 000	CHF	244 821	06.04.2022
CHF	84 216	JPY	11 100 000	06.04.2022
CLP	63 748 800	USD	80 529	06.04.2022
CNY	2 280 000	USD	359 157	06.04.2022
CHF	56 437	EUR	55 000	06.04.2022
USD	145 000	CHF	133 974	06.04.2022
EUR	100 000	CHF	102 250	06.04.2022
JPY	13 600 000	CHF	102 522	06.04.2022
USD	60 000	CHF	55 531	06.04.2022
CNY	2 280 000	USD	356 962	05.05.2022
USD	80 285	CLP	63 800 000	05.05.2022
DKK	2 490 000	CHF	341 707	05.05.2022
CAD	5 335 000	CHF	3 956 580	05.05.2022
AUD	1 825 000	CHF	1 270 388	05.05.2022
NZD	3 050 000	CHF	1 958 379	05.05.2022
SEK	1 040 000	CHF	102 069	05.05.2022
GBP	2 700 000	CHF	3 278 777	05.05.2022
MXN	22 660 000	CHF	1 053 774	05.05.2022
EUR	24 195 000	CHF	24 699 151	05.05.2022
USD	23 945 000	CHF	22 197 829	05.05.2022
MXN	810 000	EUR	37 067	05.05.2022
CHF	115 615	USD	125 000	05.05.2022
GBP	40 000	EUR	47 672	05.05.2022
CHF	214 423	USD	230 000	05.05.2022
CHF	157 786	EUR	155 000	05.05.2022
CHF	121 195	USD	130 000	05.05.2022
CHF	71 197	EUR	70 000	05.05.2022
CHF	60 829	GBP	50 000	05.05.2022
CHF	209 884	USD	225 000	05.05.2022
USD	80 000	MYR	338 800	05.05.2022
CHF	167 280	USD	180 000	05.05.2022
CHF	131 440	EUR	130 000	05.05.2022
USD	60 000	GBP	46 007	05.05.2022
CHF	222 263	USD	235 000	05.05.2022
CHF	118 194	EUR	115 000	05.05.2022
CHF	86 660	GBP	70 000	05.05.2022
CHF	151 693	USD	160 000	05.05.2022
USD	110 000	CHF	104 337	05.05.2022
USD	161 161	AUD	220 000	05.05.2022
USD	165 000	CLP	137 412 000	05.05.2022
CHF	95 504	USD	100 000	05.05.2022
USD	147 917	AUD	205 000	05.05.2022

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	72 709	NZD	115 000	05.05.2022
CHF	107 801	EUR	105 000	05.05.2022
USD	348 251	CNY	2 280 000	05.05.2022
MYR	338 800	USD	77 591	05.05.2022
GBP	70 000	CHF	84 907	05.05.2022
EUR	75 000	CHF	76 636	05.05.2022
USD	140 000	CHF	135 469	05.05.2022
CNY	2 280 000	USD	347 413	05.05.2022
MYR	338 800	USD	77 683	05.05.2022
USD	77 683	MYR	338 800	05.05.2022
EUR	140 000	SEK	1 446 958	05.05.2022
CHF	92 566	USD	95 000	05.05.2022
CLP	201 212 000	USD	234 063	05.05.2022
CHF	199 605	EUR	195 000	05.05.2022
CHF	219 602	USD	225 000	05.05.2022
USD	364 152	KRW	441 000 000	06.05.2022
JPY	1 846 100 000	CHF	13 947 926	06.05.2022
CHF	60 184	JPY	8 000 000	06.05.2022
JPY	62 600 000	CHF	463 623	06.05.2022
KRW	441 000 000	USD	346 608	06.05.2022
USD	348 424	KRW	441 000 000	06.05.2022
KRW	441 000 000	USD	348 424	06.05.2022
CHF	17 137	USD	17 544	06.05.2022
CNY	2 280 000	USD	346 794	06.06.2022
USD	232 585	CLP	201 300 000	06.06.2022
USD	70 000	ZAR	1 126 510	06.06.2022
USD	180 000	CAD	235 182	06.06.2022
AUD	205 000	USD	145 870	06.06.2022
ZAR	1 095 986	USD	70 000	06.06.2022
USD	339 791	CNY	2 280 000	06.06.2022
CAD	184 627	USD	145 000	06.06.2022
CLP	201 300 000	USD	243 116	06.06.2022
USD	77 521	MYR	339 000	07.06.2022
USD	346 630	KRW	441 000 000	07.06.2022
JPY	1 900 700 000	CHF	14 151 721	07.06.2022
USD	22 865 000	CHF	22 338 851	07.06.2022
CHF	40 549	SEK	410 000	07.06.2022
GBP	2 645 000	CHF	3 237 946	07.06.2022
DKK	2 490 000	CHF	343 745	07.06.2022
AUD	1 400 000	CHF	970 875	07.06.2022
CAD	5 335 000	CHF	4 047 148	07.06.2022
NZD	2 935 000	CHF	1 840 621	07.06.2022
MXN	23 470 000	CHF	1 114 825	07.06.2022
EUR	23 560 000	CHF	24 199 466	07.06.2022
CHF	74 222	MXN	1 560 000	07.06.2022
CHF	131 726	USD	135 000	07.06.2022
CHF	159 686	EUR	155 000	07.06.2022
CHF	52 456	AUD	75 000	07.06.2022
CHF	269 124	USD	275 000	07.06.2022
USD	40 748	CHF	40 000	07.06.2022
USD	74 397	GBP	60 000	07.06.2022
SEK	1 461 996	EUR	140 000	07.06.2022
CHF	177 212	USD	180 000	07.06.2022
CHF	83 349	EUR	80 000	07.06.2022
USD	147 382	AUD	210 000	07.06.2022
CHF	162 220	EUR	155 000	07.06.2022
CHF	163 826	USD	165 000	07.06.2022
CHF	99 073	USD	100 000	07.06.2022
EUR	115 000	CHF	120 054	07.06.2022
CHF	187 868	USD	190 000	07.06.2022
EUR	80 000	CHF	83 118	07.06.2022
USD	175 000	CHF	174 358	07.06.2022
EUR	155 000	CHF	161 280	07.06.2022
CHF	60 220	USD	60 000	07.06.2022
CHF	31 401	EUR	30 000	07.06.2022
CHF	124 507	USD	125 000	07.06.2022
CHF	152 128	EUR	145 000	07.06.2022
SEK	1 413 412	NOK	1 390 000	07.06.2022
USD	100 000	CHF	97 245	07.06.2022
USD	90 000	CHF	87 629	07.06.2022
USD	95 000	CHF	91 783	07.06.2022
CHF	57 771	USD	60 000	07.06.2022
CHF	82 561	EUR	80 000	07.06.2022
USD	180 000	CHF	173 041	07.06.2022
MXN	890 000	CHF	43 127	07.06.2022
USD	85 000	CHF	81 626	07.06.2022
GBP	115 000	SEK	1 433 236	07.06.2022
KRW	441 000 000	USD	352 026	07.06.2022
MYR	339 000	USD	77 610	07.06.2022
EUR	77 456	CHF	80 000	07.06.2022
CHF	3 266 730	GBP	2 700 000	07.06.2022
CHF	15 422	EUR	15 000	07.06.2022
USD	351 955	KRW	441 000 000	06.07.2022
CNY	2 280 000	USD	338 842	06.07.2022
USD	77 599	MYR	339 000	06.07.2022
USD	241 758	CLP	201 300 000	06.07.2022
GBP	2 700 000	CHF	3 261 932	06.07.2022

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	117 830 659,80	166,08%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	7 685 711,30	10,83%
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

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

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse P:	1,16%
Klasse Q:	0,62%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 3% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr als 3% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventarwertes vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet, dass die Anpassung angesichts vorherrschender Marktbedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berechnet. Die bestehenden und neuen Anleger werden über den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Nettoinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF	0.687616	JPY 1 = CHF	0.007451
CAD 1 = CHF	0.757837	MXN 1 = CHF	0.048625
CNY 1 = CHF	0.143997	NOK 1 = CHF	0.101966
DKK 1 = CHF	0.138021	NZD 1 = CHF	0.623968
EUR 1 = CHF	1.026847	SEK 1 = CHF	0.097975
GBP 1 = CHF	1.208061	USD 1 = CHF	0.958550

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

Art Effektenfonds

Wichtigste Daten

	ISIN	31.5.2022	31.5.2021
Nettofondsvermögen in CHF		399 687 587.21	132 817 524.84
Klasse I-A1	CH0589362521		¹
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		95.06	99.38
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		95.06	99.38
Anzahl Anteile im Umlauf		783 110,9370	526 174,5050
Klasse I-B	CH0594826163		³
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		95.42	99.53
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		95.42	99.53
Anzahl Anteile im Umlauf		2 447 920,4700	300 802,5680
Klasse I-X	CH0560699891		⁴
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		95.80	100.06
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		95.80	100.06
Anzahl Anteile im Umlauf		913 899,6230	114 606,5000
Klasse P	CH0567473944		⁴
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		95.36	99.88
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		95.36	99.88
Anzahl Anteile im Umlauf		9 886,6630	259 512,2220
Klasse Q	CH0567473951		⁴
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		95.44	99.90
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		95.44	99.90
Anzahl Anteile im Umlauf		33 310,0460	31 771,1440
Klasse U-X	CH0560699909		⁵
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		N/A	10 006.06
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		N/A	10 006.06
Anzahl Anteile im Umlauf		0,0000	1 002,0300

¹ Erstemission per 6.1.2021

² Siehe Ergänzende Angaben

³ Erstemission per 15.2.2021

⁴ Erstemission per 20.10.2020

⁵ im Umlauf bis am 9.6.2021

Performance

	Währung	2021/2022	2020/2021
Klasse I-A1 ¹	CHF	-4.2%	-
Klasse I-B ¹	CHF	-4.0%	-
Klasse I-X ¹	CHF	-4.0%	-
Klasse P ¹	CHF	-4.3%	-
Klasse Q ¹	CHF	-4.2%	-
Klasse U-X ¹	CHF	-	-

¹ Der Fonds verfügt (gemäss Fondsvertrag) über keine Benchmark, daher erfolgt kein Vergleich der Fondsperformance mit einer Benchmark.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.

Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme erhobenen Kommissionen unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers

Die Zinssätze am Schweizer Kapitalmarkt stiegen im Rechnungsjahr vom 1. Juni 2021 bis zum 31. Mai 2022 über alle Laufzeiten an, wobei die Swapkurve etwas steiler wurde. Die fünfjährigen Swapsätze zogen um 1,39% an. Damit liessen sie den negativen Bereich hinter sich und schlossen bei +0,94%. Die zehnjährigen Renditen kletterten um 1,45% auf +1,41%. Die Kreditrisikoprämien (Spreads) von Unternehmensanleihen gegenüber den Swapsätzen weiteten sich im Februar 2022 infolge der russischen Invasion in der Ukraine massiv aus, erholten sich aber in den folgenden Wochen wieder. Während des Berichtszeitraums blieben die Spreads unverändert bei 35 Basispunkten. Die Schweizerische Nationalbank (SNB) setzte ihre expansive Geldpolitik fort. Sie belies den Leitzins bei -0,75% und belastete Sichteinlagen von Banken weiter mit einem Negativzins von -0,75%. Im Jahr 2021 setzte die SNB ihre Interventionen am Devisenmarkt fort, wobei sie insgesamt Devisen für CHF 21,1 Milliarden kaufte.

Der Subfonds verbuchte einen negativen Ertrag, hauptsächlich aufgrund unseres Engagements in kurzfristigen CHF-Anleihen von russischen Emittenten mit Laufzeiten bis 2022-2023. Die Duration wurde im Durchschnitt bei rund 0,5 Jahren gehalten und war damit relativ zur zulässigen Spanne von 0 bis 2 Jahren eher kurz. Dennoch hatten die höheren Zinssätze einen negativen Kurseffekt auf die Performance des Subfonds. Die Sektorpositionierung, mit Engagements in Unternehmensanleihen (mit Investment-Grade- und Hochzinsrating), Covered Bonds in DKK und Agency-Papieren, hatte keinen Einfluss auf die (relative) Performance, während der Subfonds von positiven Zinsdifferenzen (Carry) profitierte.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	17,53
Vereinigte Staaten	7,94
Dänemark	5,41
Grossbritannien	4,72
Frankreich	4,71
Deutschland	4,10
Australien	3,88
China	3,26
Vereinigte Arabische Emirate	2,58
Chile	2,35
Übrige	17,23
Total	73,71

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	31.5.2022	31.5.2021
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	129 879 872.52 ¹	25 442 700.64
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	390 305 456.74	128 076 628.73
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	674 662.92
Derivative Finanzinstrumente	6 821 630.52	589 126.19
Sonstige Vermögenswerte	2 472 168.14	856 942.29
Gesamtfondsvermögen	529 479 127.92	155 640 060.77
Aufgenommene Kredite	-129 769 595.71	-22 813 917.04
Andere Verbindlichkeiten	-21 945.00	-8 618.89
Nettofondsvermögen	399 687 587.21	132 817 524.84

Erfolgsrechnung

	1.6.2021-31.5.2022	20.10.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	1 425.66	0.00
Negativzinsen	-41 426.95	-4 358.82
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	4 472 954.57	632 165.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	2 555 280.38	366 081.01
Total Ertrag	6 988 233.66	993 887.42
Aufwand		
Passivzinsen	-978.38	-330.51
Prüfaufwand	-14 684.90	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-167 813.63	-35 362.97
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B	-44 613.66	-625.44
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X	0.00	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P	-56 844.25	-12 002.55
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q	-8 463.68	-2 667.49
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse U-X	0.00	0.00
Sonstige Aufwendungen	-2 180.27	-2 789.18
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-790 044.03	-159 040.72
Total Aufwand	-1 085 622.80	-212 818.86
Nettoertrag	5 902 610.86	781 068.56
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ²	-1 515 364.19	-425 304.38
Realisierter Erfolg	4 387 246.67	355 764.18
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-16 893 184.91	-437 706.13
Gesamterfolg	-12 505 938.24	-81 941.95

Verwendung des Erfolges

	1.6.2021-31.5.2022	20.10.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	5 902 610.86	781 068.56
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5 902 610.86	781 068.56
Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer	-2 065 913.80	-273 374.00
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg	-3 836 697.06	-507 694.56
Vortrag auf neue Rechnung	0.00	0.00

¹ Zum 31. Mai 2022 wurden von UBS Group AG Bankguthaben in Höhe von CHF 1 120 000.00 als Sicherheiten entgegengenommen.
² Realisierte Kapitalgewinne und -verluste können Aufwendungen und Erträge aus Swinging Single Pricing enthalten.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.6.2021-31.5.2022	20.10.2020-31.5.2021
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	132 817 524.84	0.00
Abgeführte Verrechnungssteuer	-359 363.31	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	279 735 363.92	132 899 466.79
Gesamterfolg	-12 505 938.24	-81 941.95
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	399 687 587.21	132 817 524.84

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.6.2021-31.5.2022	20.10.2020-31.5.2021
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	526 174,5050	0,0000
Ausgegebene Anteile	411 165,8170	526 174,5050
Zurückgenommene Anteile	-154 229,3850	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	783 110,9370	526 174,5050
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	256 936,4320	526 174,5050
Klasse I-B		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	300 802,5680	0,0000
Ausgegebene Anteile	2 197 117,9020	300 802,5680
Zurückgenommene Anteile	-50 000,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	2 447 920,4700	300 802,5680
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	2 147 117,9020	300 802,5680
Klasse I-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	114 606,5000	0,0000
Ausgegebene Anteile	1 148 505,0930	121 406,5000
Zurückgenommene Anteile	-349 211,9700	-6 800,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	913 899,6230	114 606,5000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	799 293,1230	114 606,5000
Klasse P		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	259 512,2220	0,0000
Ausgegebene Anteile	0,0000	259 612,2220
Zurückgenommene Anteile	-249 625,5590	-100,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	9 886,6630	259 512,2220
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-249 625,5590	259 512,2220
Klasse Q		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	31 771,1440	0,0000
Ausgegebene Anteile	3 640,0460	31 871,1440
Zurückgenommene Anteile	-2 101,1440	-100,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	33 310,0460	31 771,1440
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	1 538,9020	31 771,1440
Klasse U-X		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 002,0300	0,0000
Ausgegebene Anteile	0,0000	3 004,0600
Zurückgenommene Anteile	-1 002,0300	-2 002,0300
Bestand Ende Berichtsperiode	0,0000	1 002,0300
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-1 002,0300	1 002,0300

Thesaurierung für 2021/2022

Klasse I-A1

Thesaurierung per 10.8.2022

Brutto	CHF	1.244
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.435
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.809

Klasse I-B

Thesaurierung per 10.8.2022

Brutto	CHF	1.438
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.503
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.935

Klasse I-X

Thesaurierung per 10.8.2022

Brutto	CHF	1.479
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.518
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.961

Klasse P

Thesaurierung per 10.8.2022

Brutto	CHF	1.330
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.466
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.864

Klasse Q

Thesaurierung per 10.8.2022

Brutto	CHF	1.212
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-0.424
Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.8.2022)	CHF	0.788

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 1.87500% 20-22.11.29*	CHF	200 000		200 000	199 874	0,04	
FIRST SWISS MOBILITY-REG-S 2.37500% 20-22.11.29*	CHF	200 000		200 000	199 412	0,04	
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 1.75000% 20-15.06.25*	CHF		300 000	300 000	298 193	0,06	
SWISSCARD AECS GMBH-REG-S 0.62500% 20-15.06.25*	CHF		300 000	300 000	298 632	0,06	
SWISSCARD AECS GMBH-REG-S 0.35000% 21-15.06.26*	CHF		505 000	505 000	495 786	0,09	
Total CHF					1 491 896	0,28	
Total Asset Backed Securities, fester Zins					1 491 896	0,28	
Asset-Backed-Securities, Nullcoupon							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S 0.00000% 19-16.12.28*	CHF		1 000 000	1 000 000	998 894	0,19	
Total CHF					998 894	0,19	
Total Asset-Backed-Securities, Nullcoupon					998 894	0,19	
Notes, fester Zins							
CHF							
ALPIQ HOLDING LTD 2.12500% 15-30.06.23*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 013 300	0,19	
AXPO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 22-04.02.25*	CHF		415 000	415 000	405 248	0,08	
EBN BV-REG-S 0.50000% 14-22.09.22*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 002 500	0,19	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 11-23.11.23*	CHF	500 000		500 000			
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.75000% 16-29.11.21*	CHF	500 000		500 000			
INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.05000% 19-09.10.23*	CHF		615 000	615 000	607 313	0,11	
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF		1 100 000	1 100 000	1 069 200	0,20	
KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY JSC 3.63800% 14-20.06.22*	CHF	1 255 000	360 000	1 615 000	1 595 136	0,30	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 435 500	0,27	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-SUB 4.75000% 12-24.10.22*	CHF	800 000		800 000	805 120	0,15	
TESSINER STAATSBANK 0.50000% 15-24.06.24*	CHF		1 000 000	1 000 000	998 500	0,19	
ZUGER KANTONALBANK AG 1.00000% 12-26.09.22*	CHF	1 000 000	4 020 000	5 020 000			
Total CHF					8 931 816	1,69	
EUR							
HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-REG-S 0.90000% 19-19.11.24*	EUR		800 000	800 000	796 619	0,15	
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP-REG-S 0.50000% 19-04.07.23*	EUR		1 000 000	1 000 000	990 767	0,19	
L'OREAL SA-REG-S 0.37500% 22-29.03.24*	EUR		1 000 000	1 000 000	1 017 223	0,19	
PSA BANQUE FRANCE SA-REG-S 0.62500% 19-21.06.24*	EUR		800 000	800 000	805 764	0,15	
SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.12500% 21-06.07.24*	EUR		1 000 000	1 000 000	965 236	0,18	
TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA-REG-S 5.62500% 19-02.12.24*	EUR		1 000 000	1 000 000	947 524	0,18	
Total EUR					5 523 133	1,04	
USD							
AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.12500% 18-03.07.23*	USD	600 000	1 000 000	1 600 000	1 532 447	0,29	
ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24*	USD		2 000 000	2 000 000	1 927 072	0,36	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC-REG-S 5.00000% 19-01.06.22*	USD	400 000		400 000	383 420	0,07	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 17-11.09.24*	USD		1 000 000	1 000 000	954 141	0,18	
APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25*	USD		1 750 000	1 750 000	1 685 072	0,32	
BAIDU INC 4.37500% 18-14.05.24*	USD	1 000 000		1 000 000	971 912	0,18	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 0.87500% 20-18.09.23*	USD		200 000	200 000	185 910	0,04	
BANCO SANTANDER SA 2.74600% 20-28.05.25*	USD		2 000 000	2 000 000	1 844 412	0,35	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 3.75000% 18-20.07.23*	USD		1 000 000	1 000 000	965 943	0,18	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 0.65000% 20-27.02.24*	USD		300 000	300 000	274 869	0,05	
BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25*	USD		1 200 000	1 200 000	1 144 453	0,22	
BAT CAPITAL CORP 3.22200% 18-15.08.24*	USD	250 000		250 000			
BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S 4.37500% 14-10.04.24*	USD		1 000 000	1 000 000	958 838	0,18	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35000% 21-02.12.24*	USD		1 800 000	1 800 000	1 640 177	0,31	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.55000% 19-28.03.24*	USD		500 000	500 000	393 006	0,07	
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.37500% 19-19.06.24*	USD		1 000 000	1 000 000	955 320	0,18	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.50000% 19-08.04.24*	USD	700 000	500 000	1 200 000	822 436	0,16	
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.95000% 18-27.02.23*	USD		200 000	200 000	192 462	0,04	
DIAMONDBACK ENERGY INC 2.87500% 19-01.12.24*	USD	600 000		600 000			
ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 3.62500% 15-13.10.25*	USD		500 000	500 000	474 556	0,09	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23*	USD	400 000		400 000	383 593	0,07	
GE CAPITAL INTL FUNDING CO 3.37300% 16-15.11.25*	USD		200 000	200 000			
GENERAL MOTORS CO 5.40000% 20-02.10.23*	USD		976 000	976 000	961 837	0,18	
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.15000% 17-30.06.22*	USD		200 000	200 000			
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.20000% 21-15.10.24*	USD		1 500 000	1 500 000	1 357 623	0,26	
GLENORE FUNDING LLC-REG-S 4.12500% 13-30.05.23*	USD	200 000	500 000	700 000	676 984	0,13	
HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.25000% 14-14.03.24*	USD		500 000	500 000	484 967	0,09	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 0.80000% 21-08.01.24*	USD	600 000		600 000	549 982	0,10	
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 3.00000% 17-29.08.22*	USD	200 000	500 000	700 000	671 950	0,13	
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 3.50000% 13-11.02.23*	USD	400 000		400 000			
MACQUARIE BANK LTD-REG-S 3.23100% 22-21.03.25*	USD		1 000 000	1 000 000	955 180	0,18	
MHP SA-REG-S 7.75000% 17-10.05.24*	USD		500 000	500 000	256 412	0,05	
MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24*	USD		200 000	200 000	195 470	0,04	
MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75500% 14-11.11.24*	USD		1 000 000	1 000 000	950 642	0,18	
MUFG BANK LTD-REG-S 3.75000% 14-10.03.24*	USD		200 000	200 000	193 723	0,04	
OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24*	USD		700 000	700 000	698 160	0,13	
QUANTA SERVICES INC 0.95000% 21-01.10.24*	USD		1 000 000	1 000 000	902 763	0,17	
SA GLOBAL SUKUK LTD-REG-S 0.94600% 21-17.06.24*	USD		250 000	250 000	227 656	0,04	
SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24*	USD		1 000 000	1 000 000	958 550	0,18	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 21-16.09.23*	USD		400 000	400 000	57 513	0,01	
SIEMENS FINANCIERINGSMGAATSC NV-REG-S 0.65000% 21-11.03.24*	USD		250 000	250 000	230 485	0,04	
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 3.90000% 12-17.05.22*	USD		550 000	550 000			
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT-REG-S 3.25000% 15-28.04.25*	USD		1 100 000	1 100 000	1 050 145	0,20	
SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 5.00000% 14-17.01.24*	USD		1 000 000	1 000 000	971 972	0,18	
SOCIETE GENERALE-REG-S 2.62500% 19-16.10.24*	USD	900 000		900 000	840 052	0,16	
SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC-REG-S 3.40000% 21-26.01.25*	USD	410 000		410 000	7 860	0,00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24*	USD		1 000 000	1 000 000	968 276	0,18	
STATE GRID OVERSEAS INV-REG-S 4.12500% 14-07.05.24*	USD		1 000 000	1 000 000	975 967	0,18	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 2.43400% 19-10.01.25*	USD		2 000 000	2 000 000	1 882 819	0,36	
TURKEY, REPUBLIC OF 5.12500% 11-25.03.22*	USD	200 000		200 000			
Total USD					34 717 023	6,56	
Total Notes, fester Zins					49 171 972	9,29	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Notes, Nullcoupon								
CHF								
OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.00000% 21-25.11.22*	CHF	875 000	1 000 000	875 000	1 000 000	998 300	0,19	
Total CHF						998 300	0,19	
Total Notes, Nullcoupon						998 300	0,19	
Notes, variabler Zins								
CHF								
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S-SUB 2.250%/VAR 21-PRP*	CHF		1 000 000		1 000 000	945 000	0,18	
RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS-REG-S-SUB 3.125%/VAR 21-PRP*	CHF	800 000	1 000 000		1 800 000	92 700	0,02	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 21-30.09.41*	CHF		500 000		500 000	450 000	0,08	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP*	CHF		1 600 000		1 600 000	1 456 000	0,27	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 3.375%/VAR 22-PRP*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 790 000	0,34	
Total CHF						4 733 700	0,89	
EUR								
AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29*	EUR	600 000	2 400 000	500 000	2 500 000	2 462 661	0,47	
BAYERISCHE LANDESBANK-REG-S-SUB 1.000%/VAR 21-23.09.31*	EUR		1 000 000	300 000	700 000	643 959	0,12	
CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26*	EUR		1 000 000		1 000 000	993 347	0,19	
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S SUB 1.625%/VAR 20-09.06.30*	EUR	800 000	1 100 000	300 000	1 600 000	1 565 690	0,30	
SOLWAY SA-SUB 2.500%/VAR 20-PRP*	EUR		1 500 000	900 000	600 000	566 269	0,11	
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 014 576	0,19	
Total EUR						7 246 501	1,37	
USD								
ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.400%/VAR 17-27.03.28*	USD	800 000	1 200 000		2 000 000	1 915 678	0,36	
BANCO SANTANDER SA 0.701%/VAR 21-30.06.24*	USD		800 000		800 000	744 373	0,14	
BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24*	USD		1 500 000		1 500 000	1 443 509	0,27	
CITIGROUP INC 0.776%/VAR 20-30.10.24*	USD		1 000 000		1 000 000	921 579	0,17	
CITIGROUP INC 1.281%/VAR 21-03.11.25*	USD		1 500 000		1 500 000	1 354 316	0,26	
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S-SUB 3.350%/VAR 20-PRP*	USD		750 000		750 000	712 428	0,13	
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.222%/VAR 20-18.09.24*	USD		1 404 000		1 404 000	1 311 651	0,25	
ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP*	USD		700 000		700 000	655 754	0,12	
SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.089%/VAR 21-15.03.25*	USD		2 000 000		2 000 000	1 815 328	0,34	
STANDARD CHARTERED PLC-144A 0.991%/VAR 21-12.01.25*	USD		1 000 000		1 000 000	914 747	0,17	
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 1.319%/VAR 20-14.10.23*	USD	1 000 000			1 000 000	951 214	0,18	
Total USD						12 740 577	2,41	
Total Notes, variabler Zins						24 720 778	4,67	
Medium-Term Notes, fester Zins								
AUD								
BARCLAYS PLC-REG-S 3.25000% 19-26.06.24*	AUD	500 000	750 000		1 250 000	843 490	0,16	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 6.25000% 13-08.11.23*	AUD	428 000			428 000	303 861	0,06	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.50000% 15-05.06.25*	AUD		690 000		690 000	473 373	0,09	
QANTAS AIRWAYS LTD 4.40000% 16-10.10.23*	AUD	500 000	750 000		1 250 000	861 471	0,16	
SOCIETE GENERALE-REG-S 3.92500% 18-20.09.23*	AUD	400 000			400 000	273 919	0,05	
VICINITY CENTRES TRUST 3.50000% 17-26.04.24*	AUD		400 000		400 000	273 556	0,05	
Total AUD						3 029 669	0,57	
CHF								
ABN AMRO BANK NV 1.50000% 12-18.07.23*	CHF	500 000			500 000	507 450	0,10	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.37500% 18-23.01.23*	CHF	250 000	500 000		750 000	750 450	0,14	
ADCB FINANCE CAYMAN LTD 0.72500% 18-15.02.24*	CHF		2 070 000	1 000 000	1 070 000	1 064 650	0,20	
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23*	CHF		3 465 000	1 000 000	2 465 000	2 446 513	0,46	
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.75000% 18-19.12.22*	CHF	300 000	4 445 000		4 745 000	4 685 688	0,88	
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23*	CHF	300 000			300 000	290 460	0,05	
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24*	CHF	400 000			400 000	369 600	0,07	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF		500 000	500 000				
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF		1 000 000		1 000 000	972 500	0,18	
ATHENE GLOBAL FUNDING REG-S 0.50000% 21-15.01.27*	CHF		1 000 000		1 000 000	934 500	0,18	
AUCHAN HOLDING SA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24*	CHF	970 000		970 000				
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF		880 000		880 000	830 720	0,16	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24*	CHF		500 000		500 000	493 750	0,09	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.44100% 18-21.12.23*	CHF		455 000	455 000				
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24*	CHF		495 000		495 000	486 338	0,09	
BANCO SANTANDER SA 0.75000% 17-12.06.23*	CHF		600 000		600 000	601 320	0,11	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF		1 000 000		1 000 000	964 000	0,18	
BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.30000% 15-16.09.22*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 001 400	0,19	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 2.00000% 14-22.05.24*	CHF		500 000		500 000	511 000	0,10	
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA 0.55000% 16-11.10.22*	CHF		2 300 000		2 300 000	2 304 830	0,44	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.62500% 14-08.09.21*	CHF	1 000 000		1 000 000				
BERLIN HYP AG 0.37500% 22-21.02.25*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 471 500	0,28	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24*	CHF		965 000		965 000	955 350	0,18	
BNP PARIBAS 1.87500% 12-12.09.22*	CHF		600 000		600 000	603 600	0,11	
BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28*	CHF		800 000		800 000	747 600	0,14	
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF	500 000	1 910 000		2 410 000	2 373 850	0,45	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE/CAD 0.12500% 15-22.12.25*	CHF		500 000		500 000	487 500	0,09	
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.15000% 18-31.07.23*	CHF		600 000		600 000	597 720	0,11	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 1.11500% 18-17.10.22*	CHF		250 000		250 000	251 075	0,05	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF		1 000 000		1 000 000	993 400	0,19	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 080 200	0,20	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF		1 000 000		1 000 000	980 000	0,19	
CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 413 750	0,27	
CELLNEX TELECOM SA 1.11750% 20-17.07.25*	CHF		600 000		600 000	580 800	0,11	
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 0.37100% 16-26.08.22*	CHF	500 000	2 045 000	2 545 000				
CITIGROUP INC 3.12500% 06-27.09.21*	CHF	500 000			500 000			
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 3.00000% 07-07.06.22*	CHF	1 000 000			1 000 000			
COOPERATIVA PERSONAL UNIV CHILE-REG-S 1.05000% 17-15.10.21*	CHF	1 000 000			1 000 000			
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.15000% 16-24.02.22*	CHF	500 000			500 000			
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	380 000			380 000	383 192	0,07	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.55000% 15-01.09.22*	CHF		1 920 000		1 920 000	1 923 072	0,36	
CREDIT SUISSE GROUP AG 1.00000% 15-14.04.23*	CHF		500 000		500 000	500 350	0,09	
CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 1.00000% 14-24.09.21*	CHF	500 000		500 000				
DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.37500% 13-24.07.23*	CHF	180 000			180 000			
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 16-05.07.21*	CHF	1 000 000			1 000 000			
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 17-21.03.22*	CHF	1 300 000			1 300 000			
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 18-08.02.23*	CHF	205 000	950 000		1 155 000	1 154 769	0,22	
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.62500% 19-12.09.22*	CHF		1 000 000	1 000 000				

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.30000% 16-02.11.21*	CHF		1 000 000	1 000 000				
DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24*	CHF		2 500 000		2 500 000	2 460 000	0,46	
DVB BANK SE 0.57500% 15-17.06.22*	CHF		115 000		115 000	114 989	0,02	
EMIRATES NBD PJSC 0.62500% 18-09.02.23*	CHF		1 600 000		1 600 000	1 602 080	0,30	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 0.17000% 17-18.07.25*	CHF		500 000		500 000	486 500	0,09	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.25300% 18-06.03.23*	CHF		500 000	500 000				
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23*	CHF	400 000			400 000	398 880	0,08	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF		1 000 000		1 000 000	940 500	0,18	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF		400 000		400 000	396 000	0,07	
FORD MOTOR CREDIT CO-REG-S 2.12500% 20-04.12.23*	CHF	1 050 000	2 450 000	1 000 000	2 500 000	2 507 500	0,47	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF		1 600 000		1 600 000	1 576 800	0,30	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26*	CHF		1 600 000		1 600 000	1 592 000	0,30	
HYP0 VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.50000% 22-07.04.27*	CHF		1 000 000		1 000 000	974 500	0,18	
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.26000% 20-11.02.25*	CHF		800 000	800 000				
INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.02190% 19-16.07.25*	CHF		1 000 000		1 000 000	970 500	0,18	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.80000% 22-03.02.32*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 624 137	0,50	
KIWIWIBANK LTD-REG-S 0.25000% 18-18.10.23*	CHF	400 000			400 000	397 920	0,08	
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25*	CHF		845 000		845 000	833 593	0,16	
KOREA DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 0.94000% 22-28.04.27*	CHF		1 200 000		1 200 000	1 179 600	0,22	
KOREA GAS CORP-REG-S 0.20750% 18-02.08.23*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 496 250	0,28	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.10000% 18-08.05.24*	CHF		1 000 000		1 000 000	992 500	0,19	
MBANK SA-REG-S 0.56500% 18-07.06.22*	CHF	500 000	1 120 000		1 620 000	1 619 854	0,31	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.30000% 17-19.01.26*	CHF		300 000		300 000	289 500	0,05	
MFINANCE FRANCE SA 1.00500% 17-28.03.23*	CHF		3 150 000		3 150 000	3 134 565	0,59	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.37500% 22-07.04.26*	CHF		1 000 000		1 000 000	979 500	0,18	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.35000% 15-05.08.22*	CHF		1 000 000	1 000 000				
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF		1 000 000		1 000 000	985 500	0,19	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.37500% 15-02.02.22*	CHF	500 000		500 000				
PETROLEOS MEXICANOS 2.37500% 16-14.12.21*	CHF	750 000	4 580 000	5 330 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYP0 INST 0.12500% 17-25.03.24*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 990 400	0,38	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK-REG-S 0.30000% 17-02.11.21*	CHF	1 000 000		1 000 000				
QNB FINANCE LTD-REG-S 0.022500% 21-03.06.24*	CHF	600 000			600 000	585 966	0,11	
RCI BANQUE SA 0.50000% 17-20.04.22*	CHF	800 000	760 000	1 560 000				
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.40000% 22-05.10.26*	CHF		1 000 000		1 000 000	977 500	0,18	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.38500% 21-22.07.26*	CHF		1 800 000		1 800 000	1 710 900	0,32	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF		1 000 000		1 000 000	939 500	0,18	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.37500% 15-21.08.23*	CHF		1 500 000	1 500 000				
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 0.76000% 15-17.06.22*	CHF		6 020 000		6 020 000	6 015 184	1,14	
SOCIETE GENERALE 0.40000% 17-22.02.22*	CHF	400 000		400 000				
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.87500% 19-28.02.24*	CHF		800 000		800 000	798 800	0,15	
SWEDISH MATCH AB 2.12500% 13-26.06.23*	CHF		250 000		250 000	253 700	0,05	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 1.62500% 14-01.11.24*	CHF		1 800 000		1 800 000	1 789 200	0,34	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.15000% 21-26.04.24*	CHF		1 000 000		1 000 000	957 000	0,18	
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.000001% 21-21.05.24*	CHF	800 000			800 000	781 994	0,15	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.62500% 16-23.06.23*	CHF		2 200 000		2 200 000	2 202 420	0,42	
UNICREDIT BANK (IRELAND) PLC 4.25000% 12-19.10.22*	CHF	440 000		440 000				
WESTPAC BANKING CORP 0.40000% 15-09.06.23*	CHF		660 000		660 000	660 396	0,12	
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.12500% 17-15.12.22*	CHF		600 000	600 000				
Total CHF						83 929 023	15,85	
EUR								
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP-REG-S 1.75000% 14-06.10.22*	EUR	500 000			500 000	514 012	0,10	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.37500% 19-02.10.24*	EUR	1 000 000	1 400 000	1 200 000	1 200 000	1 199 893	0,23	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 15-13.10.23*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 328 360	0,25	
BNP PARIBAS SA-REG-S 1.12500% 18-11.06.26*	EUR	1 000 000	1 000 000	300 000	1 700 000	1 668 119	0,32	
BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-REG-S 0.50000% 19-12.09.25*	EUR		800 000		800 000	786 137	0,15	
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 16-26.10.23*	EUR	200 000	700 000	900 000				
DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 1.62500% 21-16.11.23*	EUR		1 500 000		1 500 000	1 522 942	0,29	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.12500% 21-16.02.26*	EUR		2 000 000		2 000 000	1 902 233	0,36	
FORTUM OYJ-REG-S 0.87500% 19-27.02.23*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 018 355	0,19	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.25000% 16-01.05.25*	EUR	1 000 000	2 000 000	1 300 000	1 700 000	1 726 699	0,33	
INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.15000% 17-18.07.24*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 029 927	0,19	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.62500% 16-25.01.24*	EUR	200 000	200 000	400 000				
LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 0.75000% 19-15.07.24*	EUR		1 000 000		1 000 000	990 747	0,19	
MORGAN STANLEY 1.37500% 16-27.10.26*	EUR	1 000 000	2 500 000	500 000	3 000 000	2 970 460	0,56	
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S 0.50000% 20-12.08.25*	EUR	200 000	600 000		800 000	793 197	0,15	
SCHAEFFLER AG-REG-S 1.87500% 19-26.03.24*	EUR	800 000	1 200 000	300 000	1 700 000	1 734 764	0,33	
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD-REG-S 0.75000% 21-25.11.25*	EUR		1 500 000		1 500 000	1 440 322	0,27	
SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 0.01000% 20-10.09.25*	EUR		3 000 000	500 000	2 500 000	2 444 162	0,46	
VEOLIA ENVIRONNEMENT-REG-S 0.89200% 19-14.01.24*	EUR	200 000	1 100 000	300 000	1 000 000	1 025 545	0,19	
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.30000% 19-25.06.24*	EUR	200 000	500 000	700 000				
WIZZ AIR FINANCE CO BV-REG-S 1.35000% 21-19.01.24*	EUR		1 500 000	200 000	1 300 000	1 279 489	0,24	
Total EUR						25 375 363	4,79	
USD								
AIB GROUP PLC-REG-S 4.75000% 18-12.10.23*	USD		2 250 000		2 250 000	2 172 269	0,41	
BANK OF CHINA LTD/HONG KONG-REG-S 0.87500% 21-14.01.24*	USD		1 000 000		1 000 000	926 832	0,18	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 3.25000% 17-04.10.24*	USD		1 000 000		1 000 000	946 774	0,18	
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24*	USD		200 000		200 000	194 818	0,04	
LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.87500% 20-24.04.25*	USD		1 000 000		1 000 000	1 000 650	0,19	
MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 19-07.11.24*	USD	800 000	300 000		1 100 000	1 034 503	0,20	
QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24*	USD	800 000	950 000		1 750 000	1 675 156	0,32	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 4.25000% 18-14.09.23*	USD		200 000		200 000	193 366	0,04	
UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 3.05900% 22-07.04.25*	USD		1 300 000		1 300 000	1 246 207	0,24	
Total USD						9 390 574	1,77	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						121 724 629	22,99	
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
CHF								
BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 0.00000% 19-24.09.21*	CHF	1 960 000	800 000	2 760 000				
BASELSTADTSCHE KANTONALBANK 0.00000% 18-23.03.23*	CHF		2 880 000	1 880 000	1 000 000	1 000 700	0,19	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24*	CHF		800 000		800 000	786 000	0,15	
Total CHF						1 786 700	0,34	
EUR								
ALLIANZ FINANCE II BV-REG-S 0.00000% 20-14.01.25*	EUR	1 200 000		300 000	900 000	892 648	0,17	
BECTON DICKINSON AND CO 0.00000% 21-13.08.23*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 014 182	0,19	
BMW FINANCE NV-REG-S 0.00000% 20-14.01.23*	EUR	200 000		200 000				
Total EUR						1 906 830	0,36	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon						3 693 530	0,70	

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Medium-Term Notes, variabler Zins							
AUD							
BANCO SANTANDER SA-REG-S 3M BBSW+165BP 17-19.01.23*	AUD	600 000		600 000	413 910	0,08	
CREDIT SUISSE AG/SYDNEY 3M BBSW+115BP 20-26.05.23*	AUD	750 000		750 000	516 810	0,10	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 3M BBSW+110BP 20-18.02.25*	AUD	400 000		400 000	274 152	0,05	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 3M BBSW+140BP 18-07.03.25*	AUD	1 150 000		1 150 000	787 255	0,15	
QNB FINANCE LTD-REG-S 3M BBSW+175BP 18-01.02.23*	AUD	500 000	540 000	1 040 000	718 603	0,14	
Total AUD					2 710 731	0,51	
EUR							
ALLIANZ SE-REG-S-SUB 4.750%/3M EURIBOR+360BP 13-PRP*	EUR	500 000	400 000	900 000	956 526	0,18	
AVIVA PLC-REG-S-SUB 3.375%/VAR 15-04.12.45*	EUR		1 000 000	1 000 000	1 032 679	0,20	
DNB BANK ASA-REG-S-SUB 1.250%/VAR 17-01.03.27*	EUR	1 000 000	1 100 000	2 100 000			
IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP*	EUR	1 000 000	1 200 000	300 000	1 944 044	0,37	
ING GROEP NV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 17-15.02.29*	EUR		2 000 000	300 000	1 746 222	0,33	
KBC GROEP NV-REG-S-SUB 1.875%/VAR 15-11.03.27*	EUR	1 300 000	400 000	1 700 000			
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 1.750%/VAR 18-07.09.28*	EUR		2 000 000	300 000	1 726 919	0,33	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB 2.000%/VAR 17-25.07.29*	EUR		2 000 000	300 000	1 716 655	0,32	
NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 17-08.03.23*	EUR	800 000		800 000			
NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 18-04.03.25*	EUR		1 500 000	300 000	1 234 196	0,23	
NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 1.000%/VAR 16-07.09.26*	EUR	1 000 000		1 000 000			
ORANGE SA-REG-S-SUB 2.375%/VAR 19-PRP*	EUR		500 000	200 000	304 728	0,06	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-REG-S-SUB 1.375%/VAR 16-31.10.28*	EUR	800 000	1 400 000	200 000	2 036 648	0,38	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 1.250%/VAR 18-02.03.28*	EUR		1 000 000	1 000 000	1 024 087	0,19	
TOTAL SE-REG-S-SUB 2.708%/VAR 16-PRP*	EUR	1 000 000	1 000 000	200 000	1 855 817	0,35	
Total EUR					15 578 521	2,94	
GBP							
INTERCONTINENTAL HTLS-REG-S 3.750%/RATING LINKED 15-14.08.25*	GBP	351 000	150 000	501 000	610 224	0,12	
Total GBP					610 224	0,12	
USD							
BANK OF AMERICA CORP 2.816%/VAR 17-21.07.23*	USD		200 000	200 000	191 729	0,04	
DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.600%/VAR 16-PRP*	USD	200 000		200 000			
Total USD					191 729	0,04	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins					19 091 205	3,61	
Anleihen, fester Zins							
CHF							
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.05000% 15-16.12.22*	CHF		2 500 000	2 500 000			
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.06000% 16-01.07.25*	CHF		1 000 000	1 000 000	977 000	0,18	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02000% 16-17.10.24*	CHF		1 000 000	1 000 000	985 000	0,19	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.11000% 17-21.02.24*	CHF		2 175 000	2 175 000	2 160 863	0,41	
ADUNO HOLDING AG 1.12500% 14-16.07.21*	CHF	500 000		500 000			
AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.35000% 22-24.03.27*	CHF		870 000	870 000	843 030	0,16	
ALPIQ HOLDING AG 1.75000% 22-24.06.26*	CHF		1 000 000	1 000 000	987 500	0,19	
AMAG LEASING AG 0.17500% 21-16.06.25*	CHF		1 000 000	1 000 000	960 000	0,18	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.35000% 17-27.10.21*	CHF	500 000		500 000			
AMAG LEASING AG-REG-S 0.55000% 18-10.02.23*	CHF		820 000	820 000	819 180	0,15	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.25000% 21-27.10.23*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 282 450	0,24	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.21000% 21-27.06.24*	CHF		865 000	865 000	842 078	0,16	
BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23*	CHF		895 000	895 000	891 689	0,17	
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.87500% 18-14.12.21*	CHF	360 000	965 000	1 325 000			
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 1.55000% 19-11.10.22*	CHF	400 000	5 690 000	3 000 000	3 087 219	0,58	
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	250 000		250 000	244 125	0,05	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.37500% 15-19.05.22*	CHF		425 000	425 000			
BANK OF NOVA SCOTIA 0.29500% 22-25.04.25*	CHF		2 000 000	2 000 000	1 975 000	0,37	
BASELSTADTSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.12500% 13-27.03.23*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 009 600	0,19	
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 18-11.04.24*	CHF		1 000 000	1 000 000	992 500	0,19	
BKW AG-REG-S 0.75000% 18-15.10.25*	CHF		200 000	200 000	197 800	0,04	
CEMBRA MONEY BANK AG 0.50000% 15-15.09.21*	CHF	500 000		500 000			
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 1.12500% 14-24.02.23*	CHF		900 000	900 000	906 480	0,17	
CLARIANT AG-REG-S 2.12500% 14-17.10.24*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 524 750	0,29	
DIGITAL INTREPID HOLDING B-REG-S 0.60000% 22-02.10.23*	CHF		2 500 000	2 500 000	2 488 000	0,47	
DORMAKABA FINANCE AG 0.37500% 17-13.10.21*	CHF	2 150 000		2 150 000			
DUFFRY ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26*	CHF	425 000		425 000	396 950	0,07	
FIRST GULF BANK PJSC 0.62500% 15-27.05.22*	CHF		390 000	390 000			
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.57800% 19-11.03.24*	CHF		500 000	500 000	496 250	0,09	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.55000% 15-03.02.25*	CHF		3 500 000	3 500 000	3 482 500	0,66	
GALENICA SANTE LTD 0.50000% 17-15.06.23*	CHF	500 000		500 000			
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.75000% 16-30.11.21*	CHF	1 750 000		1 750 000			
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM 2.25000% 17-19.07.22*	CHF		5 010 000	2 740 000	2 270 000	1 668 450	0,32
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S 1.45000% 18-06.03.23*	CHF		2 800 000	1 230 000	1 570 000	675 100	0,13
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.12500% 18-29.05.24*	CHF		3 200 000	1 200 000	2 000 000	1 983 000	0,37
GS CALTEX CORP-REG-S 0.63300% 18-31.01.24*	CHF		350 000	350 000	348 075	0,07	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 15-01.07.21*	CHF	500 000		500 000			
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG 1.00000% 16-04.07.23*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 000 000	0,19	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG 0.80000% 17-30.05.22*	CHF	800 000	660 000	1 460 000			
HIRSLANDEN AG-REG-S 1.25000% 21-25.02.26*	CHF	400 000		400 000	387 600	0,07	
IMPLENIA AG-REG-S 1.62500% 14-15.10.24*	CHF	800 000		800 000	784 000	0,15	
IMPLENIA AG-REG-S 2.00000% 21-26.11.25*	CHF		1 000 000	1 000 000	966 000	0,18	
INVESTIS HOLDING SA 0.02500% 21-01.10.21*	CHF		1 000 000	1 000 000			
KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY NATIONAL CO JSC 3.25000% 18-05.12.23*	CHF	500 000	150 000	650 000	604 500	0,11	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 0.50000% 15-09.09.21*	CHF	1 000 000		1 000 000			
LONZA SWISS FINANCE AG 0.20000% 17-12.07.21*	CHF	500 000		500 000			
OC OERLIKON CORP AG 2.62500% 14-17.06.24*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 022 000	0,19	
ORIOR AG 0.62500% 17-26.09.23*	CHF	1 050 000		1 050 000	1 042 650	0,20	
PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 1.75000% 18-04.12.23*	CHF	250 000	20 000	270 000	266 625	0,05	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 3.37500% 07-10.10.22*	CHF	500 000		500 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.62500% 11-15.03.22*	CHF	1 000 000		1 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.00000% 12-13.08.21*	CHF	500 000		500 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.25000% 13-29.09.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 014 000	0,19	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 13-16.01.23*	CHF	1 000 000		1 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 14-23.08.24*	CHF		500 000	500 000	502 450	0,09	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.87500% 12-20.06.22*	CHF		1 000 000	1 000 000			
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-12.03.24*	CHF		1 000 000	1 000 000	995 400	0,19	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL 0.37500% 15-30.08.23*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 005 200	0,38	
RIETER HOLDING AG-REG-S 1.55000% 20-17.09.24*	CHF	500 000	1 000 000	1 500 000	1 491 750	0,28	
RZD CAPITAL PLC 2.10000% 17-02.10.23*	CHF		3 200 000	3 200 000	320 000	0,06	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SGS SA 0.25000% 15-08.05.23*	CHF		3 150 000	3 150 000				
SONOVA HOLDING AG 0.01000% 16-11.10.21*	CHF	500 000		500 000				
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-06.04.22*	CHF	500 000		500 000				
ST GALLER KANTONALBANK-SUB 2.62500% 11-30.06.21*	CHF	500 000		500 000				
ST GALLER KANTONALBANK 0.62500% 14-09.09.22*	CHF		5 000 000	5 000 000				
SULZER AG 0.37500% 16-11.07.22*	CHF		1 250 000		1 250 000	1 249 250	0,24	
SULZER AG-REG-S 0.62500% 18-22.10.21*	CHF	2 300 000		2 300 000				
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF		550 000		550 000	548 350	0,10	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.12500% 20-09.12.22*	CHF	500 000			500 000	498 800	0,09	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23*	CHF		325 000		325 000	323 635	0,06	
SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24*	CHF		1 000 000		1 000 000	974 500	0,18	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 19-03.12.21*	CHF	800 000	800 000	1 600 000				
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 0.60000% 20-07.11.22*	CHF	1 100 000	4 105 000		5 205 000	5 173 770	0,98	
TEMENOS AG-REG-S 1.87500% 18-30.11.23*	CHF	800 000	1 000 000		1 800 000	1 798 020	0,34	
TEMENOS GROUP AG 2.00000% 15-17.06.22*	CHF	750 000			750 000	749 850	0,14	
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22*	CHF	1 000 000	1 000 000		2 000 000	1 988 200	0,38	
UBS AG/LONDON-REG-S 0.17000% 20-13.05.22*	CHF	800 000	650 000	1 450 000				
WALLISER KANTONALBANK 0.20000% 16-19.08.24*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 484 250	0,28	
ZUERCHER KANTONALBANK 2.12500% 10-29.06.22*	CHF	1 000 000		1 000 000				
ZUERCHER KANTONALBANK 1.50000% 14-27.01.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 011 100	0,19	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.04000% 15-09.12.22*	CHF		575 000	575 000				
ZUERCHER KANTONALBANK 0.03000% 16-11.02.22*	CHF	1 000 000	150 000	1 150 000				
ZUGER KANTONALBANK AG 1.50000% 11-28.11.23*	CHF		200 000		200 000	203 660	0,04	
ZUGER KANTONALBANK-REG-S 0.62500% 14-17.10.22*	CHF	900 000			900 000	903 510	0,17	
ZUR ROSE GROUP AG-REG-S 2.50000% 19-21.11.24*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 881 000	0,36	
Total CHF						63 414 657	11,98	

DKK

DLR KREDIT A/S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 454 768		81 056	1 373 712	158 080	0,03	
DLR KREDIT A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	1 457 180	5 000 000	137 696	6 319 484	708 681	0,13	
DLR KREDIT A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 955 482		11 613	4 943 869	540 251	0,10	
JYSKE REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	1 400 109	5 000 000	128 153	6 271 956	701 187	0,13	
JYSKE REALKREDIT A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 841 320		29 638	4 811 682	523 820	0,10	
JYSKE REALKREDIT A/S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 435 197		82 602	1 352 595	155 650	0,03	
JYSKE REALKREDIT A/S 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	7 942 438		287 594	7 654 844	814 321	0,15	
JYSKE REALKREDIT A/S 3.00000% 22-01.10.53*	DKK		15 000 000		15 000 000	1 948 583	0,37	
JYSKE REALKREDIT A/S 3.00000% 22-01.10.53*	DKK		15 000 000		15 000 000	1 977 070	0,37	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.50000% 19-01.10.50*	DKK	1 235 199	5 000 000	123 797	6 111 402	709 597	0,13	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	1 411 546	5 000 000	131 696	6 279 850	703 153	0,13	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 830 448		11 908	4 818 540	526 229	0,10	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	4 998 861		5 444	4 993 417	527 236	0,10	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	4 991 538		1 755	4 989 783	534 600	0,10	
NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB 1.50000% 21-01.10.53*	DKK		5 000 000	13	4 999 987	565 023	0,11	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	7 754 227	5 000 000	342 391	12 411 836	1 385 466	0,26	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 443 079		77 710	1 365 369	156 884	0,03	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	7 812 610	5 000 000	43 734	12 768 876	1 390 073	0,26	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	4 997 070		1 747	4 995 323	526 575	0,10	
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	6 977 720		31 991	6 945 729	744 158	0,14	
NYKREDIT REALKREDIT A/S 3.00000% 12-01.10.44*	DKK		15 000 000	719 792	14 280 208	1 995 608	0,38	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	1 419 184		46 126	1 373 058	153 267	0,03	
REALKREDIT DANMARK A/S 1.00000% 19-01.10.50*	DKK	4 855 660		28 435	4 827 225	525 512	0,10	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.40*	DKK	1 433 455		76 828	1 356 627	156 114	0,03	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 0.50000% 19-01.10.50*	DKK	6 944 272		241 144	6 703 128	712 384	0,13	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	6 980 687		39 663	6 941 024	743 654	0,14	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% 20-01.10.53*	DKK	1 994 140		7 548	1 986 592	200 228	0,04	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.50000% 21-01.10.53*	DKK		5 000 000	54 038	4 945 962	575 130	0,11	
REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 3.00000% 22-01.10.53*	DKK		17 000 000		17 000 000	2 235 963	0,42	
REALKREDIT DANMARK A/S 2.50000% 14-01.10.47*	DKK		25 000 000	1 008 637	23 991 363	3 208 002	0,61	
Total DKK						25 802 499	4,87	

EUR

ACCOR SA-REG-S STEP-UP 17-25.01.24*	EUR		1 800 000		1 800 000	1 839 142	0,35	
MEXICO, UNITED STATES OF 1.37500% 16-15.01.25*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 012 728	0,19	
WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 0.45200% 19-25.09.23*	EUR	500 000	1 200 000		1 700 000	1 706 328	0,32	
Total EUR						4 558 197	0,86	

GBP

JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 3.87500% 15-01.03.23*	GBP		1 000 000		1 000 000	1 183 832	0,22	
Total GBP						1 183 832	0,22	

USD

COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 4.50000% 15-09.12.25*	USD		1 000 000		1 000 000	972 799	0,18	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD-REG-S 3.62500% 18-25.01.23*	USD	500 000			500 000	477 568	0,09	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 3.90000% 18-16.04.23*	USD	500 000			500 000	475 786	0,09	
MIZUHO FINANCE GRP CAY 3 LTD-REG-S-SUB 4.60000% 14-27.03.24*	USD		1 000 000		1 000 000	969 259	0,18	
UBS AG-REG-S-SUB 5.12500% 14-15.05.24*	USD	200 000			200 000	194 547	0,04	
Total USD						3 089 959	0,58	

Total Anleihen, fester Zins

98 049 144 18,52

Anleihen, Nullcoupon

CHF

BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 18-11.04.22*	CHF		1 400 000	1 400 000				
GIVAUDAN SA 0.00000% 16-07.12.22*	CHF	500 000		500 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.00000% 16-05.07.22*	CHF		7 540 000	7 540 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.00000% 16-16.05.23*	CHF		1 120 000		1 120 000	1 120 336	0,21	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.00000% 17-22.11.22*	CHF		4 740 000	4 740 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24*	CHF		650 000		650 000	643 175	0,12	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 15-25.07.23*	CHF	2 460 000			2 460 000	2 457 048	0,46	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-14.06.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	991 000	0,19	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-02.10.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	961 700	0,18	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.00000% 22-25.11.22*	CHF	7 000 000	4 000 000		3 000 000	3 003 600	0,57	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.10.25*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 942 000	0,37	
Total CHF						11 118 859	2,10	

EUR

BANK JULIUS BAER & CO AG-REG-S 0.00000% 21-25.06.24*	EUR		1 500 000		1 500 000	1 494 601	0,28	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 21-15.05.26*	EUR		3 200 000		3 200 000	3 303 653	0,62	
Total EUR						4 798 254	0,91	

Total Anleihen, Nullcoupon

15 917 113 3,01

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Anleihen, variabler Zins

CHF

BANK CLER AG-SUB 3.000%/VAR 20-PRP*	CHF	750 000			750 000	0,13	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 2.500%/VAR 19-PRP*	CHF		800 000		800 000	0,15	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF		3 000 000		3 000 000	0,54	
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FIN-REG-S-SUB 3.500%/VAR 18-PRP*	CHF		600 000		600 000	0,11	
LÜZERNER KANTONALBANK-REG-S-SUB 1.500%/VAR 20-PRP*	CHF		1 000 000		1 000 000	0,17	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENÖSSENSCHAFT-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF		1 000 000		1 000 000	0,19	
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.000%/VAR 18-PRP*	CHF		1 800 000		1 800 000	0,34	
ZUERCHER KANTONALBANK-SUB 2.125%/VAR 17-PRP*	CHF		1 000 000		1 000 000	0,19	
Total CHF					9 596 625	1,81	

EUR

AXA SA-REG-S-SUB 5.125%/3M EURIBOR+435BP 13-04.07.43*	EUR		800 000		800 000	0,16	
BAYER AG-REG-S-SUB 2.375%/VAR 15-02.04.75*	EUR	800 000	1 200 000	2 000 000			
BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 15-PRP*	EUR	600 000	200 000		800 000	0,16	
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S-SUB 0.950%/VAR 19-PRP*	EUR		1 700 000	300 000	1 400 000	0,26	
ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP*	EUR		2 000 000	500 000	1 500 000	0,28	
ENBW ENERGIE BADEN-WÜRTT-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-05.11.79*	EUR	1 000 000	1 500 000	500 000	2 000 000	0,36	
ENGIE SA-REG-S-SUB 1.375%/VAR 18-PRP*	EUR	1 000 000		1 000 000			
HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-PRP*	EUR	800 000	900 000	300 000	1 400 000	0,27	
SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP*	EUR		200 000		200 000	0,03	
UBS GROUP AG-REG-S 1.250%/VAR 18-17.04.25*	EUR		1 100 000		1 100 000	0,21	
UBS GROUP AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP*	EUR	600 000	300 000	900 000			
UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP*	EUR	600 000	900 000	300 000	1 200 000	0,22	
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 15-PRP*	EUR	300 000	500 000	800 000			
VOLKSWAGEN INTL FIN NV-REG-S-SUB 2.700%/VAR 17-PRP*	EUR	1 200 000	200 000	300 000	1 100 000	0,21	
Total EUR					11 496 597	2,17	

USD

BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP*	USD	500 000	1 400 000		1 900 000	0,34	
NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP*	USD	200 000			200 000	0,03	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP*	USD	600 000			600 000	0,10	
VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78*	USD	200 000			200 000	0,04	
Total USD					2 698 339	0,51	

Total Anleihen, variabler Zins

23 791 561 4,49

Wandelanleihen, variabler Zins

CHF

CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB COCO 3.000%/VAR 19-PRP*	CHF	300 000	1 100 000		1 400 000	0,23	
Total CHF					1 215 396	0,23	

Total Wandelanleihen, variabler Zins

1 215 396 0,23

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

360 864 418 68,15

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Asset Backed Securities, fester Zins

USD

COLT MERGER SUB INC-144A 3.60000% 18-25.02.48*	USD	200 000			200 000	0,01	
DRIVE AUTO RECEIVABLES TRUST-144A 5.09000% 18-16.06.25*	USD	250 000			250 000	0,04	
FLAGSHIP CREDIT AUTO TRUST-144A 6.25000% 16-15.10.23*	USD	600 000		600 000			
MMAF EQUIPMENT FINANCE LLC-144A 3.61000% 18-10.03.42*	USD	155 000			155 000	0,03	
SOFI CONSUMER LOAN PROGRAM LLC-144A 3.69000% 17-25.09.26*	USD	940 000		940 000			
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROG-144A 2.65000% 17-25.09.40*	USD	1 000 000			1 000 000	0,04	
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.59000% 18-25.01.48*	USD	200 000			200 000	0,02	
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM LLC-144A 2.34000% 16-25.04.33*	USD	510 000			510 000	0,01	
WORLD OMNI SELECT AUTO-144A-SUB 3.86000% 18-15.01.25*	USD	200 000		200 000			
Total USD					822 825	0,16	

Total Asset Backed Securities, fester Zins

822 825 0,16

Mortgage Backed Securities, fester Zins

USD

BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33*	USD		1 200 000		1 200 000	0,21	
COMM 2015-CRE22 MORTGAGE TRUST 3.92600% 15-01.03.48*	USD	350 000	2 000 000		2 350 000	0,42	
COMM 2015-CRE23 MORTGAGE TRUST 3.80100% 15-01.05.48*	USD		1 500 000		1 500 000	0,27	
ONE MARKET PLAZA TRUST 2017-1MKT-144A 3.61390% 17-01.02.32*	USD		500 000		500 000	0,09	
Total USD					5 217 865	0,99	

Total Mortgage Backed Securities, fester Zins

5 217 865 0,99

Mortgage Backed Securities, variabler Zins

USD

BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE-144A 3.21800% 15-01.04.33*	USD		1 000 000		1 000 000	0,17	
BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE-144A 3.49000% 15-14.04.33*	USD		190 000		190 000	0,03	
CITYLINE COMMERCIAL MORTGAGE TRUST VAR 21-01.11.31*	USD		1 500 000		1 500 000	0,26	
COMMERCIAL MORTGAGE PASS-THR-144A 3.812163%/VAR 13-01.06.46*	USD	1 000 000			1 000 000	0,18	
MAD MORTGAGE TRUST-144A 2.975%/VAR 17-01.08.34*	USD		1 600 000		1 600 000	0,28	
MAD MORTGAGE TRUST-144A 3.478%/VAR 17-01.08.34*	USD		500 000		500 000	0,09	
Total USD					5 406 137	1,02	

Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins

5 406 137 1,02

Notes, fester Zins

USD

AKER BP ASA-REG-S 4.75000% 19-15.06.24*	USD	200 000		200 000			
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BNK-REG-S-SUB 4.50000% 14-19.03.24*	USD	500 000	250 000		750 000	0,14	
GLENCORE FUNDING LLC-144A 4.12500% 13-30.05.23*	USD		750 000		750 000	0,14	
MPLX LP 3.50000% 20-01.12.22*	USD	200 000			200 000	0,04	

Titel		31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 4.87500% 18-01.03.24*	USD		985 000	985 000				
NXP BV / NXP FUNDING LLC 4.87500% 22-01.03.24*	USD		985 000		985 000	960 430	0,18	
PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 4.50000% 17-15.03.23*	USD	600 000	400 000		1 000 000	959 771	0,18	
Total USD						3 564 314	0,67	
Total Notes, fester Zins						3 564 314	0,67	
Notes, variabler Zins								
USD								
DANSKE BANK A/S-144A 3.773%/VAR 22-28.03.25*	USD		3 000 000		3 000 000	2 850 039	0,54	
ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26*	USD		750 000		750 000	713 780	0,13	
MACQUARIE GROUP LTD-144A 3.189%/VAR 17-28.11.23*	USD	200 000	1 050 000		1 250 000	1 198 078	0,23	
Total USD						4 761 897	0,90	
Total Notes, variabler Zins						4 761 897	0,90	
Medium-Term Notes, fester Zins								
AUD								
NBN CO LTD-REG-S 1.00000% 20-03.12.25*	AUD	750 000	1 250 000		2 000 000	1 221 013	0,23	
Total AUD						1 221 013	0,23	
USD								
BRIGHTHOUSE FINANCIAL GLOBAL FUND-REG-S 0.60000% 21-28.06.23*	USD		800 000		800 000	747 366	0,14	
Total USD						747 366	0,14	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						1 968 379	0,37	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
AUD								
ADCBI FINANCE CAYMAN LTD 3M BBSW+138BP 17-25.10.22*	AUD	300 000	1 150 000		1 450 000	999 037	0,19	
Total AUD						999 037	0,19	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						999 037	0,19	
Anleihen, variabler Zins								
USD								
SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80*	USD	400 000	536 000		936 000	853 833	0,16	
Total USD						853 833	0,16	
Total Anleihen, variabler Zins						853 833	0,16	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						23 594 286	4,46	

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

Investmentzertifikate, open end

Global

UBS CH SELECT MONEY MARKET FUND-USD-I-B**	USD	8		8				
Total Global							0,00	

Total Investmentzertifikate, open end

0,00

Notes, fester Zins

USD

SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25**	USD		867 000		867 000	826 908	0,16	
Total USD						826 908	0,16	

Total Notes, fester Zins

826 908

0,16

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF

EMIRATES NBD BANK PJSC 0.17000% 21-08.11.24**	CHF		2 000 000		2 000 000	1 949 900	0,37	
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 21-16.08.23**	CHF		1 000 000		1 000 000	975 480	0,18	
Total CHF						2 925 380	0,55	

Total Medium-Term Notes, fester Zins

2 925 380

0,55

Medium-Term Notes, variabler Zins

AUD

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3M BBSW+93BP 18-16.08.23**	AUD	600 000	1 000 000		1 600 000	1 104 575	0,21	
Total AUD						1 104 575	0,21	

Total Medium-Term Notes, variabler Zins

1 104 575

0,21

Anleihen, fester Zins

CHF

INTERSHOP HOLDING AG 0.05000% 21-03.03.22**	CHF		5 000 000	5 000 000				
UBS AG/LONDON 0.71000% 22-13.04.25**	CHF		1 000 000		1 000 000	989 890	0,19	
Total CHF						989 890	0,19	

Total Anleihen, fester Zins

989 890

0,19

Anleihen, Nullcoupon

CHF

INVESTIS HOLDING SA 0.00000% 21-01.02.22**	CHF		3 000 000	3 000 000				
Total CHF						0	0,00	

Total Anleihen, Nullcoupon

0

0,00

Titel	31.5.2021 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	31.5.2022 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Anleihen, variabler Zins							
EUR							
BAYER AG-REG-S 2.37500%/VAR 15-02.04.75**		EUR	1 800 000	1 800 000			
Total EUR						0,00	
Total Anleihen, variabler Zins					0	0,00	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden					5 846 753	1,10	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					390 305 457	73,71 0,00)	
Bankguthaben auf Sicht					129 879 873	24,53	
Derivative Finanzinstrumente					6 821 631	1,29	
Sonstige Vermögenswerte					2 472 167	0,47	
Gesamtfondsvermögen					529 479 128	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-129 769 596		
Andere Verbindlichkeiten					-21 945		
Nettofondsvermögen					399 687 587		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 31.5.2022	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	388 488 283	73,37
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	8 638 805	1,63
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	397 127 088	75,00

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 08.06.22*	-134	EUR	-20 855 646	1 898 188	0,36
EURO-BOBL FUTURE 08.06.22*	-360	EUR	-46 758 902	1 845 038	0,35
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.22*	-250	EUR	-28 269 089	399 957	0,08
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22*	-110	USD	-11 909 834	-18 123	0,00
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22*	-250	USD	-50 587 851	-95 481	-0,03
			-158 381 322	4 029 579	0,76

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
GS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-09.07.26**	7 000 000	CHF	7 000 000	351 174	0,07
GS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.47500% 21-09.07.26	7 000 000				
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-09.09.26**	15 000 000	CHF	15 000 000	822 285	0,16
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.49600% 21-09.09.26	15 000 000				
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-25.10.24**	20 000 000	CHF	20 000 000	433 744	0,08
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.45800% 21-25.10.24	20 000 000				
			42 000 000	1 607 203	0,31

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
ICE/ITRX.XOVER.S37-V1 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27**	1 500 000	EUR	1 608 861	68 591	0,01
			1 608 861	68 591	0,01

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
DKK	193 330 000	CHF	26 629 480	02.06.2022	-54 149	-0,01
EUR	77 240 000	CHF	79 217 112	07.06.2022	-95 638	-0,02
USD	92 075 000	CHF	89 255 848	02.06.2022	997 356	0,19
GBP	1 530 000	CHF	1 865 529	07.06.2022	17 401	0,00
AUD	13 410 000	CHF	9 331 670	02.06.2022	110 742	0,02
CHF	461 696	EUR	450 000	07.06.2022	380	0,00
CHF	877 257	USD	900 000	02.06.2022	-14 562	0,00
CHF	848 087	EUR	815 000	07.06.2022	-11 217	0,00
EUR	805 000	CHF	841 890	07.06.2022	15 288	0,00
USD	90 795 000	CHF	86 934 487	05.07.2022	62 419	0,01

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
EUR	77 170 000	CHF	79 448 136	05.07.2022	214 493	0.04
CHF	79 053 533	EUR	76 780 000	07.06.2022	-213 126	-0.04
CHF	1 851 147	GBP	1 530 000	07.06.2022	-3 019	0.00
GBP	1 530 000	CHF	1 848 538	05.07.2022	3 291	0.00
AUD	13 410 000	CHF	9 238 578	05.07.2022	29 628	0.01
DKK	188 150 000	CHF	26 022 698	05.07.2022	56 971	0.01
					1 116 258	0.21

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 08.06.22	EUR	0	134
EURO-BOBL FUTURE 08.06.22	EUR	0	360
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.22	EUR	0	250
EURO-BUND FUTURE 08.09.21	EUR	56	56
EURO-BOBL FUTURE 08.09.21	EUR	88	88
EURO-SCHATZ FUTURE 08.09.21	EUR	65	65
EURO-BUND FUTURE 08.12.21	EUR	71	71
EURO-BOBL FUTURE 08.12.21	EUR	203	203
EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.21	EUR	175	175
EURO-BUND FUTURE 08.06.21	EUR	60	0
EURO-BOBL FUTURE 08.06.21	EUR	91	0
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.21	EUR	65	0
EURO-BUND FUTURE 08.03.22	EUR	110	110
EURO-BOBL FUTURE 08.03.22	EUR	230	230
EURO-SCHATZ FUTURE 08.03.22	EUR	200	200
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.21	USD	27	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.21	USD	44	5
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.21	USD	27	27
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.21	USD	90	90
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	USD	130	130
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	USD	50	50
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	USD	280	280
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	USD	180	180
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22	USD	0	110
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.22	USD	0	250

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
GS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-09.07.26	CHF	7 000 000
GS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.47500% 21-09.07.26	CHF	7 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-09.09.26	CHF	15 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.49600% 21-09.09.26	CHF	15 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-25.10.24	CHF	20 000 000
UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.45800% 21-25.10.24	CHF	20 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.22	USD	250	250
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	USD	250	250

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
ICE/MARKIT ITRX XOVER CDI PAY 5.00000% 21-20.06.26	EUR	500 000
ICE/ITRX.XOVER.S36-V1 CDI PAY 5.00000% 21-20.12.26	EUR	1 500 000
ICE/MARKIT ITRX EUR XOVER CDI REC 5.00000% 21-20.06.26	EUR	500 000
ICE/MARKIT ITRX CDI REC 5.00000% 21-20.12.26	EUR	1 500 000
ICE/ITRX.XOVER.S37-V1 CDI REC 5.00000% 22-20.06.27	EUR	1 500 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
AUD	6 475 000	CHF	4 489 312	02.07.2021
GBP	390 000	CHF	497 537	02.07.2021
EUR	25 015 000	CHF	27 409 211	02.07.2021
USD	24 035 000	CHF	21 671 398	02.07.2021
AUD	410 000	USD	317 712	02.07.2021
USD	550 000	CHF	493 816	02.07.2021
AUD	785 000	CHF	543 839	02.07.2021
GBP	170 000	CHF	214 524	02.07.2021
AUD	2 800 000	CHF	1 940 316	02.07.2021
EUR	2 225 000	CHF	2 425 212	02.07.2021
USD	4 900 000	CHF	4 384 589	02.07.2021
USD	375 000	CHF	344 474	02.07.2021
EUR	1 445 000	CHF	1 585 240	02.07.2021
GBP	560 000	CHF	716 061	03.08.2021
AUD	10 470 000	CHF	7 247 703	03.08.2021
DKK	88 170 000	CHF	13 006 553	03.08.2021
USD	30 345 000	CHF	27 981 337	03.08.2021
EUR	28 685 000	CHF	31 466 728	03.08.2021
EUR	4 745 000	CHF	5 179 212	03.08.2021
DKK	88 170 000	CHF	12 767 786	02.09.2021
GBP	560 000	CHF	707 507	02.09.2021
USD	30 345 000	CHF	27 424 597	02.09.2021

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	33 430 000	CHF	35 976 697	02.09.2021
AUD	10 470 000	CHF	6 990 687	02.09.2021
USD	745 000	CHF	681 692	02.09.2021
DKK	88 170 000	CHF	12 809 924	04.10.2021
USD	31 090 000	CHF	28 392 694	04.10.2021
GBP	560 000	CHF	704 155	04.10.2021
EUR	33 430 000	CHF	36 128 904	04.10.2021
EUR	5 010 000	CHF	5 442 513	04.10.2021
EUR	8 185 000	CHF	8 881 093	04.10.2021
EUR	5 060 000	CHF	5 508 589	04.10.2021
USD	865 000	CHF	799 364	04.10.2021
AUD	10 470 000	CHF	7 008 775	05.10.2021
DKK	86 680 000	CHF	12 638 198	02.11.2021
USD	32 035 000	CHF	29 930 973	02.11.2021
GBP	560 000	CHF	704 506	02.11.2021
EUR	51 930 000	CHF	56 308 270	02.11.2021
AUD	10 545 000	CHF	7 100 075	02.11.2021
EUR	11 700 000	CHF	12 531 255	02.11.2021
USD	1 320 000	CHF	1 222 452	02.11.2021
EUR	9 590 000	CHF	10 292 266	02.11.2021
CHF	275 853	USD	300 000	02.11.2021
CHF	1 553 777	EUR	1 485 000	25.11.2021
DKK	87 100 000	CHF	12 430 601	02.12.2021
GBP	560 000	CHF	702 587	02.12.2021
USD	33 055 000	CHF	30 089 305	02.12.2021
EUR	73 220 000	CHF	77 685 029	02.12.2021
AUD	10 455 000	CHF	7 174 430	02.12.2021
CHF	527 572	EUR	500 000	02.12.2021
EUR	260 000	USD	301 027	02.12.2021
EUR	10 060 000	CHF	10 595 001	02.12.2021
USD	6 055 000	CHF	5 571 018	02.12.2021
EUR	2 120 000	CHF	2 232 725	02.12.2021
USD	3 600 000	CHF	3 333 120	02.12.2021
EUR	1 000 000	CHF	1 053 098	02.12.2021
EUR	1 485 000	CHF	1 553 708	02.12.2021
DKK	87 600 000	CHF	12 280 582	04.01.2022
GBP	560 000	CHF	686 225	04.01.2022
AUD	10 455 000	CHF	6 836 786	04.01.2022
EUR	86 720 000	CHF	90 442 109	04.01.2022
USD	42 000 000	CHF	38 496 360	04.01.2022
USD	1 730 000	CHF	1 585 219	04.01.2022
CHF	780 153	USD	850 000	04.01.2022
CHF	5 156 370	EUR	4 950 000	04.01.2022
DKK	37 600 000	CHF	5 274 320	04.01.2022
EUR	5 660 000	CHF	5 891 047	04.01.2022
CHF	39 236 486	USD	42 880 000	04.01.2022
CHF	90 678 025	EUR	87 430 000	04.01.2022
DKK	125 200 000	CHF	17 449 564	02.02.2022
AUD	10 455 000	CHF	6 944 608	02.02.2022
EUR	88 345 000	CHF	91 610 408	02.02.2022
GBP	560 000	CHF	691 519	02.02.2022
USD	43 070 000	CHF	39 380 279	02.02.2022
CHF	552 846	EUR	530 000	02.02.2022
EUR	845 000	CHF	886 256	02.02.2022
DKK	122 980 000	CHF	17 221 003	02.03.2022
USD	42 885 000	CHF	40 024 056	02.03.2022
GBP	560 000	CHF	702 036	02.03.2022
EUR	88 525 000	CHF	92 289 083	02.03.2022
AUD	10 455 000	CHF	6 882 296	02.03.2022
CHF	781 064	USD	850 000	02.03.2022
CHF	1 492 028	EUR	1 425 000	02.03.2022
CHF	325 000	USD	351 340	02.03.2022
CHF	937 879	EUR	900 000	02.03.2022
DKK	116 340 000	CHF	16 149 440	04.04.2022
AUD	10 455 000	CHF	6 958 430	04.04.2022
EUR	85 690 000	CHF	88 542 620	04.04.2022
GBP	560 000	CHF	691 342	04.04.2022
USD	41 145 000	CHF	37 773 373	04.04.2022
CHF	9 986 156	EUR	9 965 000	04.04.2022
GBP	970 000	CHF	1 183 299	04.04.2022
USD	1 000 000	CHF	939 525	04.04.2022
USD	1 480 000	CHF	1 377 174	04.04.2022
USD	1 300 000	CHF	1 211 302	04.04.2022
AUD	2 475 000	CHF	1 725 976	04.04.2022
USD	6 190 000	CHF	5 783 217	04.04.2022
DKK	55 120 000	CHF	7 577 543	04.04.2022
USD	905 000	CHF	842 839	04.04.2022
USD	1 640 000	CHF	1 525 867	04.04.2022
AUD	595 000	CHF	417 752	04.04.2022
USD	5 520 000	CHF	5 157 215	04.04.2022
USD	3 690 000	CHF	3 440 645	04.04.2022
DKK	10 070 000	CHF	1 395 495	04.04.2022
USD	4 675 000	CHF	4 319 240	04.04.2022
DKK	178 940 000	CHF	24 698 089	03.05.2022
GBP	1 530 000	CHF	1 854 441	03.05.2022
AUD	13 410 000	CHF	9 290 984	03.05.2022
EUR	77 715 000	CHF	79 762 868	03.05.2022
USD	68 410 000	CHF	63 174 856	03.05.2022
USD	870 000	CHF	803 120	03.05.2022
USD	12 780 000	CHF	11 817 219	03.05.2022
USD	2 260 000	CHF	2 090 480	03.05.2022
DKK	20 820 000	CHF	2 847 195	03.05.2022
USD	3 980 000	CHF	3 710 689	03.05.2022
USD	835 000	CHF	781 342	03.05.2022
USD	2 125 000	CHF	1 991 820	03.05.2022
USD	815 000	CHF	773 186	03.05.2022
DKK	193 330 000	CHF	26 629 480	02.06.2022
USD	92 075 000	CHF	89 255 848	02.06.2022
AUD	13 410 000	CHF	9 331 670	02.06.2022
CHF	877 257	USD	900 000	02.06.2022
EUR	77 240 000	CHF	79 217 112	07.06.2022
GBP	1 530 000	CHF	1 865 529	07.06.2022
CHF	461 696	EUR	450 000	07.06.2022
CHF	848 087	EUR	815 000	07.06.2022
EUR	805 000	CHF	841 890	07.06.2022
CHF	79 053 533	EUR	76 780 000	07.06.2022
CHF	1 851 147	GBP	1 530 000	07.06.2022

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
USD	90 795 000	CHF	86 934 487	05.07.2022
EUR	77 170 000	CHF	79 448 136	05.07.2022
GBP	1 530 000	CHF	1 848 538	05.07.2022
AUD	13 410 000	CHF	9 238 578	05.07.2022
DKK	188 150 000	CHF	26 022 698	05.07.2022

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	573 912 065,73	143,19%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	–	–
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission:

Klasse I-A1:	0,23% p.a.;
Klasse I-B:	0,035% p.a.;
Klasse I-X:	0,00% p.a.;
Klasse P:	0,29% p.a.;
Klasse Q:	0,27% p.a.;
Klasse U-X:	0,00% p.a.;

– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:

Klasse I-A1:	0,55% p.a.;
Klasse I-B:	0,07% p.a.;
Klasse I-X:	0,00% p.a.;
Klasse P:	1,08% p.a.;
Klasse Q:	1,05% p.a.;
Klasse U-X:	0,00% p.a.;

berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofonds-
vermögen.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich
«soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,24%
Klasse I-B:	0,04%
Klasse I-X:	0,01%
Klasse P:	0,30%
Klasse Q:	0,27%
Klasse U-X:	0,00%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen
und Rücknahmen eines Teilvermögens zu einem Netto-
vermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewer-
tungs-Nettoinventarwert dieses Teilvermögens erhöht
bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale
Anpassung beläuft sich grundsätzlich auf 3% des
Bewertungs-Nettoinventarwertes. Die Fondsleitung kann
indessen bei Vorliegen aussergewöhnlicher Umstände
für jedes Teilvermögen und/oder jeden Bewertungstag
beschliessen, vorübergehend eine Anpassung um mehr
als 3% des dann geltenden Bewertungs-Nettoinventar-
werts vorzunehmen, wenn sie hinreichend begründet,
dass die Anpassung angesichts vorherrschender Markt-
bedingungen gerechtfertigt und im besten Interesse der
Anleger ist. Eine vorübergehende Anpassung wird nach
dem von der Fondsleitung festgelegten Verfahren berech-
net. Die bestehenden und neuen Anleger werden über
den hinreichend begründeten Entscheid zur Anwendung
dieser befristeten Massnahme sowie deren Ende durch
Veröffentlichung im Publikationsorgan des Umbrella-
Fonds informiert. Zudem erfolgt eine Mitteilung an die
Aufsichtsbehörde. Ein modifizierter Bewertungs-Net-
toinventarwert berücksichtigt die Nebenkosten (Geld/
Brief-Spanne, marktkonforme Courtagen, Kommissio-
nen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage
des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des
dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der
Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhö-
hung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die
Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile
des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in
einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwer-
tes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der
Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des
Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist
somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF	0.687616	GBP 1 = CHF	1.208061
DKK 1 = CHF	0.138021	USD 1 = CHF	0.958550
EUR 1 = CHF	1.026847		

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Grundsätze der Bewertung

1. Der Nettoinventarwert eines 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 (Bewertungs-Nettoinventarwert). 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. Die Fondsleitung kann jedoch auch an Tagen, an welchen keine Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, den Nettoinventarwert eines Anteils («nicht handelbarer Nettoinventarwert») berechnen (siehe Ziff. 5.2 des Prospekts). Solche nicht handelbare Nettoinventarwerte können veröffentlicht werden, dürfen aber nur für Performance-Berechnungen und -Statistiken oder für Kommissionsberechnungen, auf keinen Fall aber als Basis für Zeichnungs- und Rücknahmeaufträge verwendet werden.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten 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 basiert auf der jeweils relevanten Zinskurve. Die auf der Zinskurve basierende Bewertung bezieht sich auf die Komponenten Zinssatz und Spread. Dabei werden folgende Grundsätze angewandt: Für jedes Geldmarktinstrument werden die der Restlaufzeit nächsten Zinssätze intrapoliert. Der dadurch ermittelte Zinssatz wird unter Zuzug eines Spreads, welcher die Bonität des zugrundeliegenden Schuldners wiedergibt, in einen Marktkurs konvertiert. Dieser Spread wird bei signifikanter Änderung der Bonität des Schuldners angepasst.
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. Derivative Finanzinstrumente, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Derivative Finanzinstrumente, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden (OTC Derivate), 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.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen des 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 entsprechendem 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 in Prozenten der Ausschüttung 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 Kommissionsätze 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 Nettofondsvermögen, getätigt wurden.

Grundsätze der Nettoinventarwertberechnung

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 des Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf CHF 0.01 gerundet.

(OTC-)Derivate und Effektenleihe

Führen die Teilvermögen ausserbörsliche Transaktionen (OTC-Geschäfte) durch, so können diese dadurch Risiken im Zusammenhang mit der Kreditwürdigkeit der OTC-Gegenpartei ausgesetzt sein: bei Abschluss von Terminkontrakten, Optionen und Swap-Transaktionen oder Verwendung sonstiger derivativer Techniken unterliegen die Teilvermögen dem Risiko, dass eine OTC-Gegenpartei ihren Verpflichtungen aus einem bestimmten oder mehreren Verträgen nicht nachkommt (bzw. nicht nachkommen kann). Das Kontrahentenrisiko kann durch die Hinterlegung einer Sicherheit verringert werden. Falls den Teilvermögen ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für die Teilvermögen verwahrt. Konkurs- und Insolvenzfälle bzw. sonstige Kreditausfallereignisse bei der OTC-Gegenpartei, der Depotbank oder innerhalb ihres Unterverwahrstellen-/Korrespondenzbanknetzwerks können dazu führen, dass die Rechte oder die Anerkennung der Teilvermögen in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was die Teilvermögen zwingen würde, ihren Verpflichtungen im Rahmen der OTC-Transaktion nachzukommen, und zwar trotz eines Wertpapiers, das zuvor zur Verfügung gestellt wurde, um eine solche Verpflichtung abzusichern.

Die Gesellschaft darf ebenfalls Teile ihres Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im Allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

Gegenparteien, Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten aus OTC-Derivaten:

Stichtag: 31.5.2022	UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable*	UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable	UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)	UBS (CH) Bond Fund – Enhanced Yield Short Term (CHF)
Währung:	CHF	CHF	CHF	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate				
Goldman Sachs	-	-	-	351 173.90
ICE Clear US Inc	-	-	-	68 591.13
LCH Group Holdings L	-	736 692.00	-	-
Morgan Stanley	-	-	-175.11	-
UBS AG	807 029.40	676 198.40	473 921.57	2 372 287.10
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:				
– Anleihen	-	-	-	-
– Aktien	-	-	-	-
– Barmittel	-	-	-	1 120 000.00
– Anlagefonds	-	-	-	-
– Geldmarktanlagen	-	-	-	-
– Übrige Sicherheiten	-	-	-	-
Total entgegengenommenen Sicherheiten	-	-	-	1 120 000.00

* ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum: 1. Juni 2021 - 31. Mai 2022	UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates Sustainable*	UBS (CH) Bond Fund – Bonds CHF Sustainable	UBS (CH) Bond Fund – Global (CHF)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 31. Mai 2022			
UBS AG			
– Marktwert der verliehenen Effekten	83 232 232.50 CHF	142 854 184.42 CHF	14 769 253.36 CHF
– Marktwert der Sicherheiten	87 420 227.29 CHF	150 042 175.93 CHF	15 512 397.62 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 31. Mai 2022			
nach Art der Vermögenswerte:			
– Anleihen	70.68	70.68	70.68
– Aktien	29.32	29.32	29.32
Effektenleihe			
Erträge aus der Effektenleihe	149 841.52 CHF	214 831.13 CHF	32 930.89 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	56 190.00 CHF	85 933.00 CHF	13 171.00 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	93 651.52 CHF	128 898.13 CHF	19 759.89 CHF

* ehemals: UBS (CH) Bond Fund – CHF Corporates

Die Erfassung der Ausgleichszahlungen und der Kommissionserträge aus Effektenleihe in den Erfolgsrechnungen sowie der Ausweis der im Inventar der Fondsvermögen der Anlagefonds ausgeliehenen Wertschriften und der erhaltenen Sicherheiten für ausgeliehene Wertschriften erfolgen nach dem Prinzip der valutagerechten Verbuchung.

UBS Fund Management (Switzerland) AG
Aeschenvorstadt 1
4002 Basel

