Halbjahresbericht 2017

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2017

FORTUNA INVEST – Long Term Bond Fund CHF
FORTUNA INVEST – Risk Control 1
FORTUNA INVEST – Risk Control 2
FORTUNA INVEST – Risk Control 3
FORTUNA INVEST – Risk Control 4
FORTUNA INVEST – Risk Control 5
FORTUNA INVEST – Risk Control 6



Fortuna Investment AG, Adliswil

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2017

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
FORTUNA INVEST – Long Term Bond Fund CHF	4	CH0115484708
FORTUNA INVEST – Risk Control 1	9	CH0237262859
FORTUNA INVEST – Risk Control 2	19	CH0237262875
FORTUNA INVEST – Risk Control 3	27	CH0237262891
FORTUNA INVEST – Risk Control 4	54	CH0237262909
FORTUNA INVEST – Risk Control 5	63	CH0237262933
FORTUNA INVEST – Risk Control 6	72	CH0237262990
Vertriebs- und Zahlstellen	82	

Verkaufsrestriktionen

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

Anlegern, die US Persons sind, dürfen keine Anteile dieses Anlagefonds angeboten, verkauft oder ausgeliefert werden. Eine US Person ist eine Person, die:

(i) eine United States Person im Sinne von Paragraf 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 Anlagefonds investieren können.

Internetadresse

www.fortunainvest.ch

Organisation

Fondsleitung

Fortuna Investment AG, Adliswil

Verwaltungsrat

René Schmidli, Präsident

Eleonora Sokolarski, Mitglied

Martha Dagmar Böckenfeld, Mitglied

Ulrich Ostholt, Mitglied

Geschäftsleitung

David Küttel, Geschäftsführer

Claudio Burkhard, Stv. Geschäftsführer

Marc Engel, Mitglied

Depotbank

EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung Lugano

Zahlstellen

EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung Lugano, Via Magatti 2, 6900 Lugano

Hinterlegungsstelle

EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung Lugano

Kundenbetreuung

investment.ch@generali.com
Tel. +41-58-472-53-06

Delegation der Anlageentscheide

FORTUNA INVEST – Risk Control 1
Pictet Asset Management S.A. mit Sitz in Genf

FORTUNA INVEST – Risk Control 2
EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung Lugano. Die EFG Bank AG hat die Anlageentscheide an die PATRIMONY 1873 SA mit Sitz in Lugano, weiterdelegiert.

FORTUNA INVEST – Risk Control 3
Deutsche Asset Management Schweiz AG, Zürich. Die Deutsche Asset Management Schweiz AG hat Teilbereiche der Anlageentscheide an die Deutsche Asset Management International GmbH mit Sitz in Frankfurt a. M., Deutschland und an die Sal. Oppenheim jr. & Cie. AG & Co. KGaA mit Sitz in Köln, Deutschland, weiterdelegiert.

FORTUNA INVEST – Risk Control 4
Credit Suisse (Schweiz) AG mit Sitz in Zürich. Die Credit Suisse (Schweiz) AG hat die Vermögensverwaltung an die Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Zürich, weiterdelegiert. Die Credit Suisse (Schweiz) AG hat die Bereitstellung der Vorgaben der Strategischen Asset Allocation an die Credit Suisse International, London, weiterdelegiert.

FORTUNA INVEST – Risk Control 5
Schroder Investment Management (Switzerland) AG mit Sitz in Zürich. Die Schroder Investment Management (Switzerland) AG hat Teilbereiche der Anlageentscheide an die Schroder Investment Management Limited mit Sitz in London, Grossbritannien, weiterdelegiert.

FORTUNA INVEST – Risk Control 6
Generali Investments Europe S.p.A. Società di gestione del risparmio mit Sitz in Triest, Italien

Delegation weiterer Teilaufgaben

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenplatz 6, 4002 Basel delegiert: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an. Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Fortuna Investment AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Zürich

Publizität

Die Fondsleitung veröffentlicht einen Jahresbericht sowie einen ungeprüften Halbjahresbericht, welche bei der Fondsleitung, der Depotbank, den Zahlstellen, bei allen Zeichnungsstellen des Teilvermögen sowie im Internet unter **www.fortunainvest.ch** und auf **www.swissfunddata.ch** bezogen werden können. Die Nettoinventarwerte der Anteile (mit Vermerk bezüglich Kommissionen) werden täglich in der «Neuen Zürcher Zeitung» sowie im «Le Temps» publiziert.

FORTUNA INVEST – Long Term Bond Fund CHF

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		11 311 494.38	10 400 387.23	8 631 801.52
	CH0115484708			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		111.97	113.20	115.75
Anzahl Anteile im Umlauf		101 024,0000	91 878,0000	74 573,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Emittenten in % des Gesamtfondsvermögens	
Switzerland Government Bond	25,15
Canton of Basel-Landschaft	5,00
Canton of Solothurn	4,82
Emissionszentrale Gem Wohnbautraeger	4,71
Pfandbriefzentrale der Schweizerischen Kantonalbanken	4,53
Kanton Basel-Stadt	4,36
Winterthur City	4,34
Pfandbriefbank der schweizerischen Hypothekarinstitute AG	3,68
St Galler Kantonalbank	2,71
Credit Agricole Home Loan SFH SA	2,66
Übrige	30,98
Total	**92,94**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	727 099.72	181 637.03
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	10 539 755.01	10 156 225.00
Sonstige Vermögenswerte	73 702.37	88 763.59
Gesamtfondsvermögen	**11 340 557.10**	**10 426 625.62**
Andere Verbindlichkeiten	-29 062.72	-26 238.39
Nettofondsvermögen	**11 311 494.38**	**10 400 387.23**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	0.01	2 157.85
Negativzinsen	-1 857.33	-8 029.21
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	-2 618.74	42 778.38
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	56 250.00	61 698.16
Erträge der Effektenleihe	198.28	393.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	-60.52	3 231.26
Total Ertrag	**51 911.70**	**102 229.79**
Aufwand		
Passivzinsen	-47.11	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-54 817.83	-96 222.68
Sonstige Aufwendungen	-20.19	-50.14
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	0.00	-35.36
Total Aufwand	**-54 885.13**	**-96 308.18**
Nettoertrag	**-2 973.43**	**5 921.61**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	4 324.54	-1 172.36
Realisierter Erfolg	**1 351.11**	**4 749.25**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-117 145.99	-221 233.14
Gesamterfolg	**-115 794.88**	**-216 483.89**

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	**CHF**
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	10 400 387.23	8 631 801.52
Abgeführte Verrechnungssteuer	-6 661.24	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	1 033 563.27	1 985 069.60
Gesamterfolg	-115 794.88	-216 483.89
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**11 311 494.38**	**10 400 387.23**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	**Anzahl**
Bestand Anfang Rechnungsjahr	91 878,0000	74 573,0000
Ausgegebene Anteile	9 146,0000	17 496,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000	-191,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**101 024,0000**	**91 878,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	9 146,0000	17 305,0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Notes, fester Zins								
CHF								
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF 1.50000% 13-26.06.28*	CHF	500 000			500 000	567 250	5,00	500 000
Total CHF						**567 250**	**5,00**	
Total Notes, fester Zins						**567 250**	**5,00**	
Medium-Term Notes, fester Zins								
CHF								
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.25000% 15-18.06.26*	CHF	300 000			300 000	301 500	2,66	
ELECTRICITE DE FRANCE 0.65000% 16-13.10.28*	CHF	200 000			200 000	192 700	1,70	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 0.17000% 17-18.07.25*	CHF		300 000		300 000	292 680	2,58	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.25000% 12-03.02.22*	CHF	100 000			100 000	106 490	0,94	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.37500% 15-21.08.23*	CHF	200 000			200 000	203 500	1,79	
Total CHF						**1 096 870**	**9,67**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**1 096 870**	**9,67**	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
COCA-COLA CO/THE 1.00000% 15-02.10.28*	CHF	200 000			200 000	211 100	1,86	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.87500% 15-31.07.24*	CHF	200 000			200 000	206 800	1,82	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRAEGER 1.75000% 10-04.11.20*	CHF	500 000			500 000	533 750	4,71	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.40000% 16-28.04.36*	CHF	300 000			300 000	285 900	2,52	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 3.00000% 12-27.09.52*	CHF	100 000			100 000	90 000	0,79	
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 1.87500% 13-21.02.25*	CHF	200 000			200 000	216 900	1,91	
LUCERNE, CANTON OF 0.12500% 17-20.06.29*	CHF		200 000		200 000	195 900	1,73	
NANT DE DRANCE SA 1.75000% 14-18.07.24*	CHF	200 000			200 000	205 800	1,81	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 0.20000% 16-07.11.31*	CHF	300 000			300 000	286 500	2,53	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 12-13.08.27*	CHF	200 000			200 000	221 080	1,95	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-15.12.27*	CHF	200 000			200 000	196 240	1,73	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.00000% 12-13.02.23*	CHF	200 000			200 000	211 960	1,87	200 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.30000% 16-06.06.31*	CHF	200 000			200 000	195 100	1,72	
SOLOTHURN, CANTON OF 1.12500% 12-29.11.27*	CHF	500 000			500 000	547 000	4,82	
ST GALLER KANTONALBANK 0.50000% 15-24.06.25*	CHF	300 000			300 000	307 650	2,71	
SWISSCOM AG 1.50000% 14-14.07.26*	CHF	200 000			200 000	219 700	1,94	
SWITZERLAND 1.25000% 12-11.06.24*	CHF	500 000			500 000	552 950	4,88	500 000
SWITZERLAND 2.00000% 10-28.04.21*	CHF	500 000			500 000	547 350	4,83	500 000
SWITZERLAND 2.00000% 11-25.05.22*	CHF	800 000			800 000	894 320	7,89	800 000
SWITZERLAND 2.25000% 05-06.07.20*	CHF	600 000			600 000	649 740	5,73	600 000
SWITZERLAND 3.00000% 03-08.01.18*	CHF	100 000			100 000	101 030	0,89	100 000
SWITZERLAND 3.00000% 04-12.05.19*	CHF	100 000			100 000	106 220	0,94	100 000
THURGAUER KANTONALBANK 1.37500% 14-28.08.23*	CHF	200 000			200 000	216 400	1,91	
URNER KANTONALBANK 0.12500% 16-27.11.26*	CHF	300 000			300 000	295 350	2,60	
WINTERTHUR, CITY OF 0.05000% 17-17.03.26*	CHF	500 000			500 000	492 000	4,34	
ZUERICH, CANTON OF 0.50000% 12-03.12.20*	CHF	110 000			110 000	113 245	1,00	107 632
Total CHF						**8 099 985**	**71,42**	
Total Anleihen, fester Zins						**8 099 985**	**71,42**	
Anleihen, Nullcoupon								
CHF								
BASEL-STADT, CANTON OF 0.00000% 16-04.09.26*	CHF	500 000			500 000	495 000	4,36	
RHAETISCHE BAHN STAMM 0.00000% 16-01.09.31*	CHF	300 000			300 000	280 650	2,47	
Total CHF						**775 650**	**6,84**	
Total Anleihen, Nullcoupon						**775 650**	**6,84**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**10 539 755**	**92,94**	
Total Wertschriften						**10 539 755**	**92,94**	
(davon ausgeliehen						3 741 627	32,99)	
Bankguthaben auf Sicht						727 100	6,41	
Sonstige Vermögenswerte						73 702	0,65	
Gesamtfondsvermögen						**11 340 557**	**100,00**	
Andere Verbindlichkeiten						-29 063		
Nettofondsvermögen						**11 311 494**		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamt-fondsvermögens[3]	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	10 539 755	92,94	10 156 225	97,41
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	–	–	–	–
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**10 539 755**	**92,94**	**10 156 225**	**97,41**

[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 / Scheinlagen
[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)

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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: 1,00%

Auflegungsdatum

1.10.2010

Umrechnungskurs

EUR 1 = CHF 1.143897

FORTUNA INVEST – Risk Control 1

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		473 724 921.70	464 415 274.17	441 712 923.06
	CH0237262859			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		97.77	96.68	96.14
Anzahl Anteile im Umlauf		4 845 120,0000	4 803 649,0000	4 594 666,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Pictet - Short-Term Money Market CHF-Z	17,72
Pictet CH - Enhanced Liquidity CHF-Z	17,71
Pictet CH - Enhanced Liquidity EUR-Z	16,91
Pictet - Short-Term Money Market EUR-Z	16,08
Verizon Communication	0,22
Intel Corp	0,22
Citigroup Inc	0,22
Unilever NV	0,21
Apple Inc	0,21
Home Depot Inc	0,21
Übrige	12,11
Total	**81,82**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	85 481 235.62[1]	85 710 233.87[2]
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	64 145 590.26	71 566 306.59
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	327 688 204.27	306 438 397.30
Derivative Finanzinstrumente	1 494 639.52	2 385 318.30
Sonstige Vermögenswerte	111 532.90	360 074.98
Gesamtfondsvermögen	**478 921 202.57**	**466 460 331.04**
Aufgenommene Kredite	-3 990 000.00	-877 290.17
Andere Verbindlichkeiten	-1 206 280.87	-1 167 766.70
Nettofondsvermögen	**473 724 921.70**	**464 415 274.17**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	35 469.00	28 583.52
Negativzinsen	-264 357.16	-396 645.40
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	788 619.94	763 284.68
– aus Gratisaktien	5.60	15.57
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	1 000 212.89
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	-6 167.95	-78 996.29
Total Ertrag	**553 569.43**	**1 316 454.97**
Aufwand		
Passivzinsen	-85 972.67	-38 768.65
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-2 345 014.59	-4 534 521.59
Teilübertrag der reglementarischen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste[3]	0.00	4 258 985.54
Sonstige Aufwendungen	-172.23	-202.32
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	1 548.17	7 707.54
Total Aufwand	**-2 429 611.32**	**-306 799.48**
Nettoertrag	**-1 876 041.89**	**1 009 655.49**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	930 324.78	4 992 648.47
Teilübertrag der reglementarischen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste[3]	0.00	-4 258 985.54
Realisierter Erfolg	**-945 717.11**	**1 743 318.42**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	6 581 656.58	3 353 407.29
Gesamterfolg	**5 635 939.47**	**5 096 725.71**

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	**CHF**
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	464 415 274.17	441 712 923.06
Abgeführte Verrechnungssteuer	-354 881.37	-2 438 851.50
Saldo aus dem Anteilverkehr	4 028 589.43	20 044 476.90
Gesamterfolg	5 635 939.47	5 096 725.71
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**473 724 921.70**	**464 415 274.17**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	**Anzahl**
Bestand Anfang Rechnungsjahr	4 803 649,0000	4 594 666,0000
Ausgegebene Anteile	47 440,0000	219 965,0000
Zurückgenommene Anteile	-5 969,0000	-10 982,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**4 845 120,0000**	**4 803 649,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	41 471,0000	208 983,0000

[1] Zum 30. September 2017 wurden von JP Morgan Bank in London Bankguthaben in Höhe von CHF 3 990 000 als Sicherheiten erhalten, sowie gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 1 570 000 als Sicherheiten hinterlegt.
[2] Zum 31. März 2017 wurden von Goldman Sachs Bankguthaben in Höhe von CHF 1 370 000 und JP Morgan Bank in London Bankguthaben in Höhe von CHF 2 240 000 als Sicherheiten erhalten, sowie gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 1 280 000 als Sicherheiten hinterlegt.
[3] gemäss Mitteilung der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 1. Januar 2009.

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Australien								
AGL ENERGY NPV*	AUD	10 260		10 260				
BRAMBLES LTD NPV*	AUD	26 543			26 543	181 370	0,04	
TELSTRA CORP NPV*	AUD	113 175		18 829	94 346	249 989	0,05	
WESFARMERS LTD NPV*	AUD	10 193			10 193	319 845	0,07	
Total Australien						**751 203**	**0,16**	
Kanada								
CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM*	CAD	2 400		2 400				
CGI GROUP INC 'A'SUB-VTG NPV*	CAD		6 900	1 200	5 700	285 325	0,06	
GILDAN ACTIVEWEAR INC COM*	CAD	7 900	1 100		9 000	271 491	0,06	
IGM FINANCIAL INC COM*	CAD	10 400		10 400				
MAGNA INTL INC COM NPV*	CAD	6 000		6 000				
METRO INC CL A SUB*	CAD	5 900		5 900				
Total Kanada						**556 816**	**0,12**	
Dänemark								
NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER'B'*	DKK	16 645		2 960	13 685	633 177	0,13	
Total Dänemark						**633 177**	**0,13**	
Frankreich								
ALTEN NPV*	EUR	3 222		3 222				
AXA EUR2.29*	EUR	20 883		2 097	18 786	549 910	0,11	
CAPGEMINI EUR8*	EUR	3 932		1 443	2 489	282 324	0,06	
DANONE EUR0.25*	EUR	4 847		4 847				
SANOFI EUR2*	EUR	7 150		647	6 503	624 930	0,13	
SCHNEIDER ELECTRIC EUR8*	EUR	5 288		788	4 500	379 013	0,08	
UNIBAIL-RODAMCO EUR5*	EUR	1 196		1 196				
Total Frankreich						**1 836 177**	**0,38**	
Deutschland								
BEIERSDORF AG NPV*	EUR	2 642			2 642	275 109	0,06	
CONTINENTAL AG ORD NPV*	EUR	1 323		274	1 049	257 689	0,05	
SAP AG ORD NPV*	EUR	8 580		1 668	6 912	732 864	0,15	
Total Deutschland						**1 265 661**	**0,26**	
Hongkong								
CLP HOLDINGS HKD5*	HKD	29 000	9 000	6 000	32 000	317 334	0,07	
HYSAN DEVELOPMENT HKD5*	HKD	60 000	16 000	14 000	62 000	282 264	0,06	
JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)*	USD	3 600	600		4 200	257 490	0,05	
SUN HUNG KAI PROP NPV*	HKD	13 000	3 000		16 000	251 529	0,05	
SWIRE PROPERTIES LTD HKD1*	HKD	63 000	19 800	18 000	64 800	212 729	0,04	
Total Hongkong						**1 321 346**	**0,28**	
Israel								
BANK HAPOALIM B.M. ILS1*	ILS	58 558		58 558				
CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01*	USD	5 300		5 300				
Total Israel							**0,00**	
Japan								
ASTELLAS PHARMA NPV*	JPY	23 400			23 400	287 938	0,06	
BRIDGESTONE CORP NPV*	JPY	10 700		1 500	9 200	403 795	0,08	
CANON INC NPV*	JPY	12 300		12 300				
DAITO TRUST CONST NPV*	JPY	1 800		400	1 400	246 703	0,05	
FUJI FILM HLD CORP NPV*	JPY	8 000		8 000				
HIROSE ELECTRIC NPV*	JPY	1 400		1 400				
JAPAN TOBACCO INC NPV*	JPY	20 500		5 300	15 200	481 867	0,10	
KDDI CORP NPV*	JPY	16 700		2 400	14 300	364 709	0,08	
KOBAYASHI PHARMACE NPV*	JPY	5 400		5 400				
MITSUBISHI ELEC CP NPV*	JPY	23 500		23 500				
MITSUBISHI TANABE PHARMA CORP NPV*	JPY	12 900		2 600	10 300	228 428	0,05	
NITORI HOLDINGS CO LTD*	JPY	1 700		1 700				
NTT DOCOMO NPV*	JPY	22 100		4 700	17 400	384 467	0,08	
ORIX CORP NPV*	JPY	24 700		24 700				
PANASONIC CORP NPV*	JPY		18 200		18 200	255 085	0,05	
SEVEN & I HOLDINGS NPV*	JPY	6 200		6 200				
SUBARU CORPORATION NPV*	JPY	7 700			7 700	268 726	0,06	
Total Japan						**2 921 718**	**0,61**	
Niederlande								
ING GROEP N.V. EUR0.01*	EUR	25 612		3 336	22 276	397 511	0,08	
Total Niederlande						**397 511**	**0,08**	
Norwegen								
ORKLA ASA NOK1.25*	NOK	26 410		26 410				
Total Norwegen							**0,00**	
Singapur								
OVERSEA-CHINESE BK NPV*	SGD	34 400		34 400				
Total Singapur							**0,00**	
Schweden								
SWEDISH MATCH NPV*	SEK	7 122		1 752	5 370	181 872	0,04	
Total Schweden						**181 872**	**0,04**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Schweiz								
SWISS RE AG CHF0.10*	CHF	4 494		647	3 847	337 382	0,07	
Total Schweiz						**337 382**	**0,07**	
Grossbritannien								
3I GROUP ORD GBP0.738636*	GBP	28 489		5 105	23 384	277 156	0,06	
COMPASS GROUP ORD GBP0.1105*	GBP		16 134	1	16 133	331 536	0,07	
COMPASS GROUP ORD GBP0.10625*	GBP	16 779		16 779				
DIAGEO ORD GBP0.28 101/108*	GBP	21 835		21 835				
NATL EXPRESS GRP ORD GBP0.05*	GBP		85 424	13 028	72 396	332 606	0,07	
PERSIMMON ORD GBP0.10*	GBP	7 805		7 805				
RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10*	GBP	6 051		643	5 408	478 311	0,10	
RELX PLC GBP0.1444*	GBP	23 169		23 169				
UBM PLC ORD GBP0.1125(POST CONSOLID*	GBP	24 411		24 411				
WPP PLC ORD GBP0.10*	GBP		17 839	3 045	14 794	265 993	0,06	
Total Grossbritannien						**1 685 603**	**0,35**	
Vereinigte Staaten								
3M CO COM*	USD	5 700		5 700				
ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'*	USD	4 900		500	4 400	575 052	0,12	
AFLAC INC COM USD0.10*	USD	6 800		1 500	5 300	417 391	0,09	
AGILENT TECHNOLOGIES INC COM*	USD	4 600	1 700	1 100	5 200	323 024	0,07	
AIR PRODS & CHEMS COM USD1*	USD		3 000	500	2 500	365 801	0,08	
ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333*	USD	13 000		2 000	11 000	675 017	0,14	
AMER EXPRESS CO COM USD0.20*	USD	8 100		1 500	6 600	577 692	0,12	
AMGEN INC COM USD0.0001*	USD		4 900	800	4 100	739 677	0,15	
ANTHEM INC COM USD0.01*	USD	3 700		400	3 300	606 302	0,13	
APPLE INC COM NPV*	USD	7 700		1 000	6 700	999 148	0,21	
APPLIED MATLS INC COM*	USD	10 200		10 200				
APTARGROUP INC COM*	USD		1 100		1 100	91 865	0,02	
AUTO DATA PROCESS COM USD0.10*	USD	2 800		600	2 200	232 712	0,05	
AUTOZONE INC COM USD0.01*	USD	300		300				
AVERY DENNISON CORP COM*	USD	1 200			1 200	114 185	0,02	
BAXTER INTL INC COM USD1*	USD	4 500	2 200	1 100	5 600	340 015	0,07	
BB&T CORP COM USD5*	USD		9 800	1 400	8 400	381 521	0,08	
BEMIS INC COM*	USD	5 900		4 600	1 300	57 322	0,01	
BIOGEN INC COM STK USD0.0005*	USD		1 600	220	1 380	418 105	0,09	
BRIGHTHOUSE FINL I COM USD0.01 WI*	USD		582		582	34 239	0,01	
BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USD0.10*	USD	14 200		1 200	13 000	801 773	0,17	
BROWN FORMAN CORP CL B*	USD		1 300		1 300	68 303	0,01	
BUNGE LIMITED COM USD0.01*	USD	3 600		3 600				
CARDINAL HEALTH INC COM*	USD		3 300		3 300	213 681	0,04	
CARLISLE COS INC COM*	USD		3 500	700	2 800	271 714	0,06	
CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAIRED STOCK)*	USD	3 700		3 700				
CHURCH & DWIGHT INC COM*	USD		1 200		1 200	56 256	0,01	
CIGNA CORP COM USD0.25*	USD	2 500	200	400	2 300	416 031	0,09	
CISCO SYSTEMS COM USD0.001*	USD	31 400		4 000	27 400	891 607	0,19	
CITIGROUP INC COM USD0.01*	USD	16 700		2 000	14 700	1 034 633	0,22	
COCA-COLA CO COM USD0.25*	USD	25 600		25 600				
COGNIZANT TECHNOLO COM CL'A'USD0.01*	USD	5 200		900	4 300	301 816	0,06	
COLGATE-PALMOLIVE COM USD1*	USD	6 000		6 000				
CONAGRA BRANDS IN COM USD5*	USD	6 600			6 600	215 469	0,04	
CORNING INC COM USD0.50*	USD		8 700		8 700	251 870	0,05	
CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01*	USD	10 200	500	1 600	9 100	716 036	0,15	
DELPHI AUTOMOTIVE COM USD0.01*	USD	3 400		700	2 700	257 072	0,05	
DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01*	USD	4 700			4 700	293 237	0,06	
DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01*	USD	6 600		700	5 900	505 061	0,11	
EBAY INC COM USD0.001*	USD	9 600		1 800	7 800	290 268	0,06	
ELI LILLY AND CO COM NPV*	USD		7 100	800	6 300	521 442	0,11	
EMERSON ELEC CO COM*	USD	16 100		3 700	12 400	753 969	0,16	
EVEREST RE GROUP COM USD0.01*	USD	1 300			1 300	287 287	0,06	
EXPRESS SCRIPTS HL COM USD0.01*	USD		6 000	1 000	5 000	306 342	0,06	
FISERV INC COM USD0.01*	USD		2 600		2 600	324 432	0,07	
FOOT LOCKER INC COM USD0.01*	USD	2 600		2 600				
FRANKLIN RES INC COM*	USD	8 600		1 400	7 200	310 089	0,06	
GEN ELEC CO COM USD0.06*	USD		41 000	5 000	36 000	842 276	0,18	
GENUINE PARTS CO COM STK USD1*	USD	2 500		2 500				
GILEAD SCIENCES COM USD0.001*	USD	11 000		900	10 100	791 789	0,17	
GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01*	USD	4 370	200	560	4 010	920 315	0,19	
GRACE W R & CO DEL NEW COM*	USD	1 500		1 500				
GRAINGER W W INC COM*	USD	1 180		1 180				
HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01*	USD		5 000		5 000	268 170	0,06	
HASBRO INC COM*	USD	2 900		600	2 300	217 363	0,05	
HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01*	USD		4 500	800	3 700	284 942	0,06	
HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01*	USD		500		500	49 730	0,01	
HERSHEY CO COM*	USD	2 400		2 400				
HOME DEPOT INC COM USD0.05*	USD		7 300	1 000	6 300	997 042	0,21	
HP INC COM USD0.01*	USD	21 200	2 300	3 300	20 200	390 129	0,08	
ILLINOIS TOOL WKS COM NPV*	USD	900	2 500	500	2 900	415 182	0,09	
INTEL CORP COM USD0.001*	USD	30 400	1 500	3 600	28 300	1 042 748	0,22	
INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20*	USD	6 200	1 000	1 000	6 200	870 352	0,18	
INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001*	USD		400	70	330	333 958	0,07	
JOHNSON & JOHNSON COM USD1*	USD	8 600		1 000	7 600	956 062	0,20	
JP MORGAN CHASE & COM USD1*	USD		12 000	1 400	10 600	979 604	0,20	
KELLOGG CO COM USD0.25*	USD	3 700		1 000	2 700	162 943	0,03	
KIMBERLY CLARK CORP COM*	USD	3 400	500	600	3 300	375 762	0,08	
LOWE'S COS INC COM USD0.50*	USD		6 100	900	5 200	402 220	0,08	
LYONDELLBASELL IND COM USD0.01*	USD	5 900		1 300	4 600	440 868	0,09	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MARSH & MCLENNAN COM USD1*	USD	1 600		1 600				
MASCO CORP COM*	USD	6 500			6 500	245 349	0,05	
MCCORMICK & CO INC COM N/VTG NPV*	USD		700		700	69 520	0,01	
MCDONALD'S CORP COM USD0.01*	USD	6 400		6 400				
MERCK & CO INC COM USD0.50*	USD	16 800		2 000	14 800	916 940	0,19	
METLIFE INC COM USD0.01*	USD	5 300	2 300	1 200	6 400	321 708	0,07	
MONDELEZ INTL INC COM USD0.01*	USD	16 400		1 500	14 900	586 205	0,12	
NEWMARKET CORP COM*	USD	700		140	560	230 695	0,05	
NIKE INC CLASS'B'COM NPV*	USD		10 900	1 100	9 800	491 667	0,10	
NUCOR CORP COM*	USD		900		900	48 802	0,01	
ORACLE CORP COM USD0.01*	USD	20 500	600	2 600	18 500	865 494	0,18	
OREILLY AUTO NEW COM USD0.01*	USD	1 450		200	1 250	260 490	0,05	
PEPSICO INC CAP USD0.016666*	USD	9 900		1 200	8 700	938 031	0,20	
PERKINELMER INC COM USD1*	USD	5 100		1 000	4 100	273 615	0,06	
PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'*	USD	9 700		9 700				
PNC FINANCIAL SVCS COM USD5*	USD		3 600	500	3 100	404 251	0,08	
PPG INDS INC COM*	USD	4 200		600	3 600	378 502	0,08	
PROCTER & GAMBLE COM NPV*	USD	11 800		11 800				
PUBLIC STORAGE COM USD0.10*	USD	1 400	400	310	1 490	308 515	0,06	
QUALCOMM INC COM USD0.0001*	USD	11 400	700	2 400	9 700	486 556	0,10	
RENAISSANCE RE HLG COM USD1*	USD	2 700	200	500	2 400	313 828	0,07	
SCHEIN HENRY INC COM*	USD		5 700	1 900	3 800	301 467	0,06	
SHERWIN-WILLIAMS COM USD1*	USD	1 100	100	190	1 010	349 904	0,07	
SIMON PROP GROUP COM USD0.0001*	USD	3 170		700	2 470	384 809	0,08	
SONOCO PRODS CO COM*	USD	2 000			2 000	97 631	0,02	
STANLEY BLACK & DE COM USD2.50*	USD	1 900	1 700	500	3 100	452 844	0,09	
STRYKER CORP COM USD0.10*	USD	3 400	700	500	3 600	494 707	0,10	
SYNOPSYS INC COM USD0.01*	USD		3 500		3 500	272 723	0,06	
T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20*	USD	4 500		800	3 700	324 538	0,07	
TARGET CORP COM STK USD0.0833*	USD	5 100	800	1 200	4 700	268 361	0,06	
TEXAS INSTRUMENTS COM USD1*	USD	12 800		1 600	11 200	971 439	0,20	
TJX COS INC COM USD1*	USD		6 600	900	5 700	406 645	0,08	
TORCHMARK CORP COM*	USD	3 500	3 000	800	5 700	441 722	0,09	
TRAVELERS CO INC COM NPV*	USD	6 900		1 000	5 900	699 447	0,15	
TUPPERWARE BRANDS CORP COM*	USD		900		900	53 835	0,01	
TWENTY-FIRST CENTU COM USD0.01 CL'A'*	USD	21 000		2 200	18 800	479 875	0,10	
UGI CORP NEW COM*	USD		1 600		1 600	72 547	0,02	
UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01*	USD		5 600	800	4 800	909 621	0,19	
VALIDUS HOLDING LT COM STK USD0.175*	USD	3 300		3 300				
VERIZON COMMUN COM USD0.10*	USD	21 600	3 300	2 600	22 300	1 067 869	0,22	
VF CORP COM NPV*	USD	4 900	2 600	1 100	6 400	393 666	0,08	
WAL-MART STORES IN COM USD0.10*	USD	13 900		1 600	12 300	929 982	0,19	
WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01*	USD		6 900	800	6 100	455 780	0,10	
WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01*	USD	9 700	800	1 200	9 300	887 000	0,19	
YUM BRANDS INC COM*	USD	3 700		3 700				
Total Vereinigte Staaten						**44 635 488**	**9,32**	
Total Inhaberaktien						**56 523 953**	**11,80**	
Weitere Aktien								
Niederlande								
UNILEVER NV CVA EUR0.16*	EUR	19 607		2 134	17 473	1 000 165	0,21	
Total Niederlande						**1 000 165**	**0,21**	
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV*	CHF	4 092		642	3 450	852 840	0,18	
Total Schweiz						**852 840**	**0,18**	
Total Weitere Aktien						**1 853 005**	**0,39**	
Vorzugsaktien								
Deutschland								
HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV*	EUR	2 597		442	2 155	283 856	0,06	
Total Deutschland						**283 856**	**0,06**	
Total Vorzugsaktien						**283 856**	**0,06**	
Namensaktien								
Frankreich								
MICHELIN (CGDE) EUR2*	EUR	2 539		460	2 079	293 703	0,06	
Total Frankreich						**293 703**	**0,06**	
Deutschland								
ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)*	EUR	3 511		584	2 927	635 988	0,13	
BASF SE NPV*	EUR	8 143		8 143				
MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)*	EUR	2 379		292	2 087	431 865	0,09	
SIEMENS AG NPV(REGD)*	EUR		4 016	456	3 560	485 415	0,10	
TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57*	USD	6 200		800	5 400	433 992	0,09	
Total Deutschland						**1 987 259**	**0,41**	
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF		13 457	2 647	10 810	258 791	0,05	
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	4 606		1 373	3 233	243 768	0,05	
ALLREAL HOLDING AG CHF50*	CHF	3 103		344	2 759	468 202	0,10	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	14 021		3 326	10 695	867 365	0,18	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)*	CHF	13 975		13 975				
PSP SWISS PROPERTY CHF0.10 (REGD)*	CHF		687		687	61 280	0,01	
RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'*	CHF	5 620		1 382	4 238	375 063	0,08	
SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF		317		317	66 031	0,01	
UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*	CHF		20 503	3 551	16 952	280 556	0,06	
Total Schweiz						**2 621 057**	**0,55**	
Vereinigte Staaten								
CHUBB LIMITED ORD CHF24.15*	USD		3 700	500	3 200	441 380	0,09	
TORO CO COM*	USD		800		800	48 039	0,01	
Total Vereinigte Staaten						**489 420**	**0,10**	
Total Namensaktien						**5 391 439**	**1,13**	
Investmentzertifikate, closed end								
Belgien								
COFINIMMO SA NPV*	EUR		751		751	93 338	0,02	
Total Belgien						**93 338**	**0,02**	
Total Investmentzertifikate, closed end						**93 338**	**0,02**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**64 145 590**	**13,39**	

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

Investmentzertifikate, open end								
Global								
PICTET (CH) MONEY MARKET - (USD)-Z**	USD	81 242		81 242				
PICTET - SHORT-TERM MONEY MARKET CHF-Z-DISTRIBUTION**	CHF		961 400		961 400	84 882 102	17,72	
PICTET CH - ENHANCED LIQUIDITY CHF-Z-DY**	CHF		92 300		92 300	84 817 239	17,71	
PICTET CH-ENHANCED LIQUIDITY EUR-ZDY-DISTRIBUTIVE**	EUR		73 250		73 250	80 969 211	16,91	
PICTET MONEY MARKET - (EUR)-Z**	EUR	68 020		68 020				
PICTET-SHORT-TERM MONEY MARKET USD-Z-CAP**	USD	592 185		592 185				
PICTET-SHORT-TERM MONEY MARKET EUR-Z-CAP**	EUR	477 600			477 600	77 019 653	16,09	
Total Global						**327 688 205**	**68,43**	
Total Investmentzertifikate, open end						**327 688 205**	**68,43**	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**327 688 205**	**68,43**	
Total Wertschriften						**391 833 795**	**81,82**	
(davon ausgeliehen							0,00)	
Bankguthaben auf Sicht						85 481 236	17,85	
Derivative Finanzinstrumente						1 494 640	0,31	
Sonstige Vermögenswerte						111 532	0,02	
Gesamtfondsvermögen						**478 921 203**	**100,00**	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-3 990 000		
Andere Verbindlichkeiten						-1 206 281		
Nettofondsvermögen						**473 724 922**		

Bewertungskategorie	**Verkehrswert per 30.09.2017**	**in % des Gesamt-fondsvermögens[3]**	**Verkehrswert Vorjahr**	**in %**
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	67 188 705	14,03	72 239 299	15,49
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	326 139 729	68,10	308 150 723	66,06
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**393 328 434**	**82,13**	**380 390 022**	**81,55**

[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 / Scheinlagen
[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 Indices/Commodities/Währungen					
MSCI WORLD NR INDEX FUTURE 15.12.17*	-64	USD	3 485 218	-35 298	-0.01
			3 485 218	-35 298	-0.01

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17*	605	USD	31 883 702	-529 785	-0.11
			31 883 702	-529 785	-0.11
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-OAT FUTURE 07.12.17*	320	EUR	56 788 524	-391 670	-0.08
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.17*	104	EUR	13 339 574	-1 784	0.00
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.17*	80	USD	12 781 996	-137 883	-0.03
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17*	81	USD	9 821 442	-71 028	-0.01
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17*	166	USD	34 646 581	-85 328	-0.02
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17*	250	USD	28 423 250	-154 966	-0.03
EURO-BUND FUTURE 07.12.17*	85	EUR	15 655 200	-104 038	-0.03
			171 456 567	-946 697	-0.20

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
JP MORGAN/CDX IG 28 CDSI GEN 5Y CDI REC 1.00000% 17-20.06.22**	3 260 000	USD	3 220 781	66 405	0.01
JP MORGAN/CDX IG 28 CDSI GEN 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22**	132 022 700	USD	130 434 433	2 689 268	0.56
JPMORGAN/CDX EM CDSI S27 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22**	12 547 000	USD	12 140 477	-375 397	-0.08
JPM/CDX.NA.HY.28 CDI REC 5.00000% 17-20.06.22**	23 807 000	USD	24 856 378	1 820 725	0.38
GOLDMAN SACHS/CDX.NA.HY.28 CDI REC 5.00000% 17-20.06.22**	2 200 000	USD	2 297 250	168 530	0.04
GOLDMAN SACHS/CDX IG 28 CDSI GEN 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22**	3 100 000	USD	3 062 706	63 146	0.01
JP MORGAN/CDX IG CDSI S28 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22**	3 400 000	USD	3 359 097	69 257	0.01
JP MORGAN/CDX IG CDSI S28 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22**	2 600 000	USD	2 568 721	52 961	0.01
			181 939 843	4 554 895	0.94

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 385 280 112

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
ZAR	26 728 000	CHF	1 913 928	22.11.2017	21 714	0.00
GBP	1 966 000	CHF	2 432 925	22.11.2017	-114 331	-0.02
USD	2 805 000	CHF	2 693 361	22.11.2017	-10 892	0.00
SEK	3 889 000	CHF	463 522	22.11.2017	2 741	0.00
CHF	19 220 323	USD	20 017 000	22.11.2017	77 724	0.02
SGD	1 940 000	CHF	1 368 993	22.11.2017	-9 132	0.00
CAD	2 102 000	CHF	1 606 348	22.11.2017	-14 590	0.00
USD	2 250 000	CHF	2 160 225	22.11.2017	-8 962	0.00
AUD	1 689 000	CHF	1 281 782	22.11.2017	4 910	0.00
USD	48 474 000	CHF	46 530 193	22.11.2017	-202 761	-0.04
USD	3 650 000	CHF	3 503 635	22.11.2017	-15 268	0.00
USD	4 986 000	CHF	4 786 061	22.11.2017	-20 856	0.00
JPY	306 648 000	CHF	2 705 379	22.11.2017	71 938	0.02
EUR	141 196 000	CHF	160 059 786	22.11.2017	-1 343 427	-0.28
EUR	5 412 000	CHF	6 135 043	22.11.2017	-51 493	-0.01
HKD	4 577 000	CHF	562 696	22.11.2017	-3 027	0.00
HKD	42 110 000	CHF	5 177 003	22.11.2017	-27 851	-0.02
MXN	21 729 000	CHF	1 164 176	22.11.2017	20 464	0.00
TWD	106 606 000	USD	3 530 935	22.11.2017	10 378	0.00
INR	180 531 000	USD	2 789 631	22.11.2017	44 782	0.01
BRL	7 267 000	USD	2 268 102	22.11.2017	-13 117	0.00
KRW	4 559 152 000	USD	4 019 707	22.11.2017	32 580	0.01
					-1 548 476	-0.31

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 Indices/Commodities/Währungen			
MSCI WORLD NR INDEX FUTURE 16.06.17	USD	214	0
MSCI WORLD NR INDEX FUTURE 15.09.17	USD	228	228
MSCI WORLD NR INDEX FUTURE 15.12.17	USD	0	64

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.17	USD	0	617
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.09.17	USD	617	617
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17	USD	605	0
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-OAT FUTURE 08.06.17	EUR	205	310
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.17	USD	55	78
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.17	USD	112	159
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.17	USD	57	80
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.17	USD	169	240
EURO-BUND FUTURE 08.06.17	EUR	53	80
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.17	EUR	64	96
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.17	USD	82	82
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.17	USD	168	168
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.09.17	USD	81	81
EURO-OAT FUTURE 07.09.17	EUR	346	346
EURO-BUND FUTURE 07.09.17	EUR	88	88
EURO-SCHATZ FUTURE 07.09.17	EUR	109	109
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.17	USD	253	253
EURO-OAT FUTURE 07.12.17	EUR	334	14
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.17	EUR	104	0
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.17	USD	80	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17	USD	81	0
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17	USD	166	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17	USD	250	0
EURO-BUND FUTURE 07.12.17	EUR	85	0

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
GOLDMAN SACHS/CDX.NA.HY.27 CDI REC 5.00000% 16-20.12.21	USD	4 230 000
GOLDMAN SACHS/CDX.NA.HY.27 CDI REC 5.00000% 16-20.12.21	USD	21 189 000
GOLDMAN SACHS/CDX.NA.IG.27 CDI REC 1.00000% 16-20.12.21	USD	13 820 000
JP MORGAN/CDX.NA.HY.27 CDI REC 5.00000% 16-20.12.21	USD	2 918 000
JP MORGAN/CDX IG 28 CDSI GEN 5Y CDI REC 1.00000% 17-20.06.22	USD	3 260 000
JP MORGAN/CDX IG 28 CDSI GEN 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22	USD	163 022 700
JPMORGAN/CDX EM CDSI S27 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22	USD	12 547 000
JPM/CDX.NA.HY.28 CDI REC 5.00000% 17-20.06.22	USD	23 807 000
GOLDMAN SACHS/CDX.NA.HY.28 CDI REC 5.00000% 17-20.06.22	USD	2 200 000
GOLDMAN SACHS/CDX IG 28 CDSI GEN 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22	USD	3 100 000
JP MORGAN/CDX IG CDSI S28 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22	USD	3 400 000
JP MORGAN/CDX IG CDSI S28 5Y REC 1.00000% 17-20.06.22	USD	2 600 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	3 477 836	USD	3 499 885	02.05.2017
USD	2 946 000	CHF	2 921 843	26.05.2017
USD	18 055 000	CHF	17 603 625	26.05.2017
CHF	1 227 227	AUD	1 689 000	26.05.2017
CHF	1 513 020	CAD	2 102 000	26.05.2017
CHF	5 214 843	JPY	595 848 000	26.05.2017
CHF	1 970 568	ZAR	26 728 000	26.05.2017
CHF	1 364 276	SGD	1 940 000	26.05.2017
CHF	433 653	SEK	3 889 000	26.05.2017
CHF	1 132 014	MXN	21 729 000	26.05.2017
CHF	2 498 196	GBP	1 966 000	26.05.2017
CHF	2 122 968	EUR	1 945 000	26.05.2017
CHF	156 796 158	EUR	143 652 000	26.05.2017
CHF	171 279 260	USD	175 617 000	26.05.2017
CHF	50 518 589	USD	51 798 000	26.05.2017
CHF	5 274 278	HKD	42 110 000	26.05.2017
CHF	573 269	HKD	4 577 000	26.05.2017
CHF	10 271	HKD	82 000	26.05.2017
USD	3 557 090	TWD	106 606 000	26.05.2017
USD	4 079 778	KRW	4 559 152 000	26.05.2017
USD	2 212 177	BRL	7 267 000	26.05.2017
CHF	104	NOK	911	07.06.2017
CHF	777 553	USD	806 088	07.06.2017
CHF	350 000	HKD	2 852 509	05.07.2017
CAD	800 000	USD	616 251	06.07.2017
USD	6 600 000	CHF	6 377 705	07.08.2017

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
ILS	200 000	CHF	53 990	07.08.2017
JPY	55 000 000	CHF	481 696	07.08.2017
SGD	30 000	CHF	21 363	07.08.2017
CAD	120 000	CHF	92 239	08.08.2017
CHF	17 507 934	USD	18 055 000	25.08.2017
AUD	1 689 000	CHF	1 218 107	25.08.2017
CAD	2 102 000	CHF	1 506 293	25.08.2017
JPY	595 848 000	CHF	5 204 822	25.08.2017
ZAR	26 728 000	CHF	1 927 231	25.08.2017
SGD	1 940 000	CHF	1 357 403	25.08.2017
SEK	3 889 000	CHF	433 218	25.08.2017
MXN	21 729 000	CHF	1 108 057	25.08.2017
GBP	1 966 000	CHF	2 490 234	25.08.2017
EUR	1 945 000	CHF	2 120 439	25.08.2017
EUR	143 652 000	CHF	156 609 410	25.08.2017
USD	175 617 000	CHF	170 278 243	25.08.2017
USD	51 798 000	CHF	50 223 341	25.08.2017
HKD	42 110 000	CHF	5 253 433	25.08.2017
HKD	4 577 000	CHF	571 004	25.08.2017
HKD	82 000	CHF	10 230	25.08.2017
TWD	106 606 000	USD	3 558 515	25.08.2017
KRW	4 559 152 000	USD	4 071 035	25.08.2017
BRL	7 267 000	USD	2 118 041	25.08.2017
CHF	10 117	HKD	82 000	25.08.2017
USD	2 250 000	CHF	2 159 213	25.08.2017
USD	3 650 000	CHF	3 502 723	25.08.2017
EUR	4 735 000	CHF	5 140 790	25.08.2017
CHF	10 857 000	EUR	10 000 000	25.08.2017
CHF	168 556 319	USD	175 617 000	25.08.2017
USD	5 775 000	CHF	5 525 231	25.08.2017
EUR	5 649 000	CHF	6 416 134	25.08.2017
USD	4 986 000	CHF	4 830 786	25.08.2017
CHF	1 900 923	USD	1 962 000	25.08.2017
CHF	2 534 730	JPY	289 200 000	25.08.2017
CHF	8 815 748	USD	9 099 000	25.08.2017
EUR	7 544 000	CHF	8 665 038	25.08.2017
CHF	7 944 866	EUR	6 917 000	25.08.2017
CHF	1 953 087	ZAR	26 728 000	25.08.2017
CHF	2 440 003	GBP	1 966 000	25.08.2017
CHF	463 915	SEK	3 889 000	25.08.2017
CHF	1 375 887	SGD	1 940 000	25.08.2017
USD	20 017 000	CHF	19 330 417	25.08.2017
CHF	1 614 336	CAD	2 102 000	25.08.2017
CHF	2 172 600	USD	2 250 000	25.08.2017
CHF	1 290 734	AUD	1 689 000	25.08.2017
CHF	46 801 647	USD	48 474 000	25.08.2017
CHF	3 524 075	USD	3 650 000	25.08.2017
CHF	4 813 983	USD	4 986 000	25.08.2017
CHF	2 709 862	JPY	306 648 000	25.08.2017
CHF	160 229 221	EUR	141 196 000	25.08.2017
CHF	6 141 538	EUR	5 412 000	25.08.2017
CHF	564 802	HKD	4 577 000	25.08.2017
CHF	5 196 374	HKD	42 110 000	25.08.2017
CHF	1 188 273	MXN	21 729 000	25.08.2017
USD	3 521 371	TWD	106 606 000	25.08.2017
USD	2 805 000	CHF	2 691 257	28.08.2017
INR	180 531 000	USD	2 779 110	28.08.2017
CHF	2 708 789	USD	2 805 000	28.08.2017
USD	4 017 936	KRW	4 559 152 000	28.08.2017
USD	2 815 298	INR	180 531 000	28.08.2017
ZAR	26 728 000	CHF	1 913 928	22.11.2017
GBP	1 966 000	CHF	2 432 925	22.11.2017
USD	2 805 000	CHF	2 693 361	22.11.2017
SEK	3 889 000	CHF	463 522	22.11.2017
CHF	19 220 323	USD	20 017 000	22.11.2017
SGD	1 940 000	CHF	1 368 993	22.11.2017
CAD	2 102 000	CHF	1 606 348	22.11.2017
USD	2 250 000	CHF	2 160 225	22.11.2017
AUD	1 689 000	CHF	1 281 782	22.11.2017
USD	48 474 000	CHF	46 530 193	22.11.2017
USD	3 650 000	CHF	3 503 635	22.11.2017
USD	4 986 000	CHF	4 786 061	22.11.2017
JPY	306 648 000	CHF	2 705 379	22.11.2017
EUR	141 196 000	CHF	160 059 786	22.11.2017
EUR	5 412 000	CHF	6 135 043	22.11.2017
HKD	4 577 000	CHF	562 696	22.11.2017
HKD	42 110 000	CHF	5 177 003	22.11.2017
MXN	21 729 000	CHF	1 164 176	22.11.2017
TWD	106 606 000	USD	3 530 935	22.11.2017
INR	180 531 000	USD	2 789 631	22.11.2017
BRL	7 267 000	USD	2 268 102	22.11.2017
KRW	4 559 152 000	USD	4 019 707	22.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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.

Zusammengesetzte
TER für die letzten 12 Monate: 1,02%

Auflegungsdatum

1.9.2014

Umrechnungskurse

AUD	1	=	CHF	0.759227	MXN	1	=	CHF	0.053284
CAD	1	=	CHF	0.773678	NOK	1	=	CHF	0.121553
DKK	1	=	CHF	0.153714	NZD	1	=	CHF	0.699478
EUR	1	=	CHF	1.143897	SEK	1	=	CHF	0.118544
GBP	1	=	CHF	1.298181	SGD	1	=	CHF	0.712545
HKD	1	=	CHF	0.123881	USD	1	=	CHF	0.967600
ILS	1	=	CHF	0.273906	ZAR	1	=	CHF	0.071661
JPY	1	=	CHF	0.008596					

FORTUNA INVEST – Risk Control 2

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		474 078 441.92	470 717 263.72	456 838 693.85
	CH0237262875			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		99.77	99.96	99.20
Anzahl Anteile im Umlauf		4 751 488,0000	4 708 904,0000	4 605 397,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
United States Treasury	23,43
New Capital Institutional Fund – Bonds CHF	14,39
Switzerland Government Bonds	13,15
Source EURO STOXX 50 ETF	5,95
NESTLE SA	4,68
New Capital Fund Lux – Cash CHF	4,54
NOVARTIS AG	3,80
ROCHE Holding AG	3,17
Bundesrepublik Deutschland Government Bond	1,22
Übrige	8,63
Total	**82,96**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	80 694 077.76[1]	81 912 258.03[2]
– auf Zeit	0.00	8 007 600.00
Geldmarktinstrumente	12 024 437.77	3 000 570.84
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	88 426 418.15	89 045 519.00
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	170 276 125.66	156 629 150.93
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	123 980 964.09	131 643 239.79
Derivative Finanzinstrumente	-1 492 757.50	-1 145 377.24
Sonstige Vermögenswerte	1 845 256.24	2 850 444.61
Gesamtfondsvermögen	**475 754 522.17**	**471 943 405.96**
Aufgenommene Kredite	-462 633.93	-33 187.54
Andere Verbindlichkeiten	-1 213 446.32	-1 192 954.70
Nettofondsvermögen	**474 078 441.92**	**470 717 263.72**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	74 453.68	291 012.02
Negativzinsen	-232 549.72	-505 063.61
Erträge der Geldmarktinstrumente	42 587.36	0.00
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	1 154 080.49	1 977 801.25
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	1 825 816.99	3 510 269.69
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	797 612.50	1 690 592.71
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	16 585.57	93 850.77
Total Ertrag	**3 678 586.87**	**7 058 462.83**
Aufwand		
Passivzinsen	-1 477.27	-10 395.51
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-2 361 182.65	-4 623 103.47
Sonstige Aufwendungen	-60.33	-211.21
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-2 667.61	-39 049.10
Total Aufwand	**-2 365 387.86**	**-4 672 759.29**
Nettoertrag	**1 313 199.01**	**2 385 703.54**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-348 643.95	-3 432 984.45
Realisierter Erfolg	**964 555.06**	**-1 047 280.91**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-349 372.93	4 801 731.00
Gesamterfolg	**615 182.13**	**3 754 450.09**

[1] Zum 30. September 2017 wurden gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 2 020 000 als Sicherheiten hinterlegt.
[2] Zum 31. März 2017 wurden von EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 2 350 000 als Sicherheiten erhalten.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	470 717 263.72	456 838 693.85
Abgeführte Verrechnungssteuer	-1 501 731.82	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	4 247 727.89	10 124 119.78
Gesamterfolg	615 182.13	3 754 450.09
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**474 078 441.92**	**470 717 263.72**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	4 708 904,0000	4 605 397,0000
Ausgegebene Anteile	51 452,0000	168 202,0000
Zurückgenommene Anteile	-8 868,0000	-64 695,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**4 751 488,0000**	**4 708 904,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	42 584,0000	103 507,0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Schweiz								
IDORSIA AG CHF0.05*	CHF		8 500	8 500				
SWATCH GROUP CHF2.25(BR)*	CHF	2 050			2 050	825 740	0,17	
SWISS RE AG CHF0.10*	CHF	28 700			28 700	2 516 990	0,53	
Total Schweiz						**3 342 730**	**0,70**	
Total Inhaberaktien						**3 342 730**	**0,70**	
Weitere Aktien								
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV*	CHF	61 100			61 100	15 103 920	3,17	
Total Schweiz						**15 103 920**	**3,17**	
Total Weitere Aktien						**15 103 920**	**3,17**	
Namensaktien								
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF	158 300			158 300	3 789 702	0,80	
ACTELION CHF0.50(REGD)*	CHF	8 500		8 500				
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	9 500			9 500	716 300	0,15	
CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)*	CHF	115 800	6 155		121 955	1 869 570	0,39	
GEBERIT CHF0.10(REGD)*	CHF	4 200			4 200	1 924 020	0,40	
GIVAUDAN AG CHF10*	CHF	930			930	1 959 510	0,41	
JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*	CHF	12 000			12 000	687 600	0,14	
LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)*	CHF	29 270			29 270	1 656 682	0,35	
LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*	CHF		6 300		6 300	1 600 200	0,34	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	274 300			274 300	22 245 730	4,68	
NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)*	CHF	218 000			218 000	18 072 200	3,80	
RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'*	CHF	37 200			37 200	3 292 200	0,69	
SGS LTD CHF1(REGD)*	CHF	700			700	1 626 100	0,34	
SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)*	CHF	1 400			1 400	477 540	0,10	
SWISSCOM AG CHF1(REGD)*	CHF	3 620			3 620	1 796 244	0,38	
UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*	CHF	271 000			271 000	4 485 050	0,94	
ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*	CHF	12 800			12 800	3 781 120	0,79	
Total Schweiz						**69 979 768**	**14,71**	
Total Namensaktien						**69 979 768**	**14,71**	
Investmentzertifikate, open end								
Eurozone								
DB X-TRACKERS EURO STOXX 50 ETF-IC/CAPITALISATION*	EUR	275 000		275 000				
SOURCE MKTS PLC - DOW JONES EURO STOXX 50 SOURCE-A-ETF-CAP*	EUR	296 000	41 000		337 000	28 291 346	5,95	
Total Eurozone						**28 291 346**	**5,95**	
Vereinigte Staaten								
MULTI UNITS LUX SICAV-LYXOR UCITS ETF S&P 500-SHS-D-USD*	USD	175 000			175 000	4 346 701	0,91	
Total Vereinigte Staaten						**4 346 701**	**0,91**	
Total Investmentzertifikate, open end						**32 638 047**	**6,86**	
Anrechte								
Schweiz								
CREDIT SUISSE GRP RIGHTS 07.06.17*	CHF		121 955	121 955				
Total Schweiz							**0,00**	
Total Anrechte							**0,00**	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
SWITZERLAND 2.00000% 10-28.04.21*	CHF	24 100 000			24 100 000	26 382 270	5,55	
SWITZERLAND 2.00000% 11-25.05.22*	CHF	13 000 000			13 000 000	14 532 700	3,05	
SWITZERLAND 2.25000% 05-06.07.20*	CHF	10 850 000			10 850 000	11 749 465	2,47	
SWITZERLAND 3.00000% 04-12.05.19*	CHF	9 300 000			9 300 000	9 878 460	2,08	
Total CHF						**62 542 895**	**13,15**	
EUR								
GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 459 012	0,52	
Total EUR						**2 459 012**	**0,52**	
Total Anleihen, fester Zins						**65 001 907**	**13,66**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Anleihen, Nullcoupon								
EUR								
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-09.04.21*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 825 866	1,22	
Total EUR						**5 825 866**	**1,22**	
Total Anleihen, Nullcoupon						**5 825 866**	**1,22**	
Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 09-15.05.19*	USD	26 000 000		26 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 10-15.11.20*	USD	49 500 000	26 000 000		75 500 000	75 202 604	15,81	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 16-30.11.21*	USD		10 000 000		10 000 000	9 643 121	2,03	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.12500% 17-31.03.24*	USD		8 000 000		8 000 000	7 742 913	1,63	
Total USD						**92 588 639**	**19,46**	
Total Treasury-Notes, fester Zins						**92 588 639**	**19,46**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**284 480 876**	**59,80**	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 2.12500% 11-15.08.21*	USD	7 000 000			7 000 000	6 859 714	1,44	
Total USD						**6 859 714**	**1,44**	
Total Treasury-Notes, fester Zins						**6 859 714**	**1,44**	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**6 859 714**	**1,44**	

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

Inhaberaktien								
Schweiz								
ACTELION LTD CHF0.50 N 2ND LINE**	CHF		8 500	8 500				
Total Schweiz							**0,00**	
Total Inhaberaktien							**0,00**	
Namensaktien								
Schweiz								
SYNGENTA CHF0.10 (TENDERED 2ND LINE)**	CHF	9 400		9 400				
Total Schweiz							**0,00**	
Total Namensaktien							**0,00**	
Investmentzertifikate, open end								
Global								
NEW CAPITAL FUND LUX - CASH CHF M**	CHF	220 000			220 000	21 621 600	4,54	
NEW CAPITAL INSTITUTIONAL FUND - BONDS CHF**	CHF	620 000			620 000	68 466 600	14,39	
Total Global						**90 088 200**	**18,94**	
Italien								
WHITE FLEET III SICAV - GLOBES ITALY EQUITY STAR (EUR) I-CAP**	EUR	5 000	3 000		8 000	1 254 717	0,26	
Total Italien						**1 254 717**	**0,26**	
Total Investmentzertifikate, open end						**91 342 917**	**19,20**	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**91 342 917**	**19,20**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Nicht-Effekten								
Treasury-Bills, Nullcoupon								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 10.11.16-11.05.17**	USD	3 000 000		3 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 30.03.17-29.03.18**	USD		12 500 000		12 500 000	12 024 439	2,52	
AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 30.03.17-28.09.17**	USD		12 000 000	12 000 000				
Total USD						**12 024 439**	**2,52**	
Total Treasury-Bills, Nullcoupon						**12 024 439**	**2,52**	
Total Nicht-Effekten						**12 024 439**	**2,52**	
Total Wertschriften						**394 707 946**	**82,96**	
(davon ausgeliehen							0,00)	
Bankguthaben auf Sicht						80 694 078	16,96	
Derivative Finanzinstrumente						-1 492 758	-0,31	
Sonstige Vermögenswerte						1 845 256	0,39	
Gesamtfondsvermögen						**475 754 522**	**100,00**	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-462 634		
Andere Verbindlichkeiten						-1 213 446		
Nettofondsvermögen						**474 078 442**		

Bewertungskategorie	**Verkehrswert per 30.09.2017**	**in % des Gesamt-fondsvermögens[3]**	**Verkehrswert Vorjahr**	**in %**
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	290 625 182	61,09	285 655 511	60,53
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	102 590 006	21,56	93 517 593	19,82
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**393 215 188**	**82,65**	**379 173 104**	**80,35**

[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 Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17*	-175	EUR	7 158 506	-292 266	-0.06
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17*	-370	CHF	33 784 700	-939 800	-0.20
			40 943 206	-1 232 066	-0.26
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17*	-600	USD	68 215 800	498 916	0.10
EURO-BOBL FUTURE 07.12.17*	-33	EUR	4 951 860	17 742	0.01
			73 167 660	516 658	0.11

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	42 000 000	CHF	48 216 000	24.11.2017	206 424	0.04
USD	110 000 000	CHF	105 050 000	24.11.2017	-983 774	-0.20
					-777 350	-0.16

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 Indices/Commodities/Währungen			
SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.17	CHF	499	50
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.17	CHF	499	499
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.17	EUR	175	175
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17	EUR	0	175
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17	CHF	0	370
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.17	USD	600	48
EURO-BOBL FUTURE 08.06.17	EUR	50	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.17	USD	600	600
EURO-BOBL FUTURE 07.09.17	EUR	50	50
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17	USD	0	600
EURO-BOBL FUTURE 07.12.17	EUR	0	33

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
USD	100 000 000	CHF	95 400 000	15.09.2017
EUR	42 000 000	CHF	45 742 200	15.09.2017
USD	10 000 000	CHF	9 610 000	15.09.2017
EUR	42 000 000	CHF	48 216 000	24.11.2017
USD	110 000 000	CHF	105 050 000	24.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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.

Zusammengesetzte
TER für die letzten 12 Monate: 1,03%

Auflegungsdatum

1.9.2014

Umrechnungskurse

EUR	1	=	CHF	1.143897
USD	1	=	CHF	0.967600

FORTUNA INVEST – Risk Control 3

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		1 266 485 970.46	1 209 705 932.61	1 094 486 449.69
	CH0237262891			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		100.39	99.38	98.83
Anzahl Anteile im Umlauf		12 616 068,0000	12 172 712,0000	11 074 935,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Emittenten in % des Gesamtfondsvermögens	
Switzerland Government Bonds	13,01
Bundesrepublik Deutschland Government Bonds	6,74
DB Advisors Emerging Markets Equities - Passive	5,09
France Government Bonds	4,82
Netherlands Government Bonds	1,61
Austria Government Bond	1,09
Belgium Government Bonds	1,02
Sparebanken Vest Boligkredit	0,76
Ayt Cedulas Cajas Global	0,72
Danske Bank	0,64
Übrige	49,06
Total	**84,56**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	196 260 937.79[1]	380 205 213.78
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	216 911 541.84	201 068 848.48
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	843 647 283.34	807 521 394.71
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	67 991 194.52	65 620 488.77
Derivative Finanzinstrumente	1 210 917.29	-3 935 353.39
Sonstige Vermögenswerte	8 640 164.28	9 684 641.02
Gesamtfondsvermögen	**1 334 662 039.06**	**1 460 165 233.37**
Aufgenommene Kredite	-64 942 818.16	-247 422 510.02
Andere Verbindlichkeiten	-3 233 250.44	-3 036 790.74
Nettofondsvermögen	**1 266 485 970.46**	**1 209 705 932.61**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	13 507.96	32 847.76
Negativzinsen	-412 549.06	-587 639.46
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	3 147 475.05	4 622 100.18
– aus Gratisaktien	52 587.42	291 453.42
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	9 350 730.82	17 540 300.22
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	957 681.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	97 621.24	447 974.79
Total Ertrag	**12 249 373.43**	**23 304 717.91**
Aufwand		
Passivzinsen	-128 066.76	-202 217.06
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-6 211 314.41	-11 426 575.80
Reglementarische Performance Fee-Vergütung an die Fondsleitung	0.00	-13 342.16
Übertrag der reglementarischen Performance Fee-Vergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste	0.00	13 342.16
Sonstige Aufwendungen	-414.77	-483.93
Total Aufwand	**-6 339 795.94**	**-11 629 276.79**
Nettoertrag	**5 909 577.49**	**11 675 441.12**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-34 671 963.93	-891 236.68
Teilübertrag der reglementarischen Performance Fee-Vergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste	0.00	-13 342.16
Realisierter Erfolg	**-28 762 386.44**	**10 770 862.28**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	45 395 255.75	1 887 974.73
Gesamterfolg	**16 632 869.31**	**12 658 837.01**

[1] Zum 30. September 2017 wurden gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 9 030 000 als Sicherheiten hinterlegt.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 209 705 932.61	1 094 486 449.69
Abgeführte Verrechnungssteuer	-4 158 853.92	-5 357 052.30
Saldo aus dem Anteilverkehr	44 306 022.46	107 917 698.21
Gesamterfolg	16 632 869.31	12 658 837.01
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**1 266 485 970.46**	**1 209 705 932.61**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	12 172 712,0000	11 074 935,0000
Ausgegebene Anteile	443 356,0000	1 097 777,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**12 616 068,0000**	**12 172 712,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	443 356,0000	1 097 777,0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Australien								
AGL ENERGY NPV*	AUD	14 618		14 618				
AMCOR LIMITED NPV*	AUD	16 197			16 197	187 040	0,01	
ASX LTD NPV*	AUD	1 600	479		2 079	82 757	0,01	
AURIZON HOLDINGS NPV*	AUD	22 562			22 562	83 935	0,01	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD NPV*	AUD	3 841			3 841	33 857	0,00	
CROWN RESORTS LTD NPV*	AUD	3 000			3 000	25 761	0,00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD NPV*	AUD	1 200			1 200	41 007	0,00	
FORTESCUE METALS G NPV*	AUD		22 195		22 195	86 614	0,01	
INCITEC PIVOT NPV*	AUD	24 617		24 617				
INSURANCE AUST GRP NPV*	AUD	28 122			28 122	136 006	0,01	
LEND LEASE GROUP NPV*	AUD	4 000			4 000	54 421	0,00	
MEDIBANK PRIVATE L NPV*	AUD	21 934			21 934	48 626	0,00	
NEWCREST MINING NPV*	AUD	67 773			67 773	1 081 587	0,08	
QBE INS GROUP NPV*	AUD		10 255		10 255	77 937	0,01	
SONIC HEALTHCARE NPV*	AUD	3 000			3 000	47 626	0,00	
TABCORP HLDGS LTD NPV*	AUD		16 783		16 783	54 409	0,00	
TATTS GROUP LTD NPV*	AUD	12 000			12 000	36 261	0,00	
TELSTRA CORP NPV*	AUD	34 101			34 101	90 358	0,01	
WESFARMERS LTD NPV*	AUD	9 890			9 890	310 337	0,02	
WOODSIDE PETROLEUM NPV*	AUD	7 200		7 200				
Total Australien						**2 478 540**	**0,19**	
Österreich								
ANDRITZ AG NPV(BR)*	EUR	6 254		6 254				
ERSTE GROUP BK AG NPV*	EUR		9 699	6 023	3 676	153 670	0,01	
OMV AG NPV(VAR)*	EUR	2 593	1 505	2 593	1 505	84 856	0,01	
VOESTALPINE AG NPV*	EUR	8 618	1 000		9 618	474 681	0,04	
Total Österreich						**713 208**	**0,05**	
Belgien								
ANHEUSER-BUSCH IN NPV*	EUR	16 894	2 792	2 809	16 877	1 955 652	0,15	
COLRUYT SA NPV*	EUR	3 957		1 087	2 870	142 268	0,01	
KBC GROUP NV NPV*	EUR	11 167	1 151	1 231	11 087	909 327	0,07	
PROXIMUS SA NPV*	EUR	34 957			34 957	1 165 827	0,09	
UCB NPV*	EUR	5 147		5 147				
UMICORE NPV*	EUR	8 015		8 015				
Total Belgien						**4 173 073**	**0,31**	
Kanada								
1ST CAP REALTY INC COM NPV*	CAD	1 949			1 949	29 675	0,00	
AGNICO EAGLE MINES LTD COM*	CAD	11 803	12 497		24 300	1 060 153	0,08	
AGRIUM INC COM NPV*	CAD	1 223	334		1 557	161 081	0,01	
BANK MONTREAL QUE COM*	CAD	5 108	535		5 643	412 268	0,03	
BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM*	CAD	9 975	463		10 438	647 667	0,05	
BCE INC COM NEW*	CAD	15 615			15 615	706 254	0,05	
CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM*	CAD	3 070	625		3 695	312 089	0,02	
CI FINANCIAL CORP COM NPV*	CAD	2 535			2 535	53 523	0,00	
ENBRIDGE INC COM NPV*	CAD	5 899		5 899				
FAIRFAX FINL HLDGS LTD SUB VTG*	CAD		2 469	2 469				
FORTIS INC COM NPV*	CAD	3 619			3 619	125 381	0,01	
FRANCO NEVADA CORP COM NPV*	CAD	8 500	7 868		16 368	1 224 059	0,09	
GREAT WEST LIFECO INC COM*	CAD	2 264			2 264	62 900	0,00	
IGM FINANCIAL INC COM*	CAD	960			960	31 150	0,00	
INTACT FINL CORP COM NPV*	CAD	3 747			3 747	298 797	0,02	
KEYERA CORPORATION COM NPV*	CAD	1 384			1 384	40 839	0,00	
MANULIFE FINL CORP COM*	CAD		16 769		16 769	328 367	0,02	
PEYTO EXPLORATION COM NPV*	CAD	1 299			1 299	20 502	0,00	
POWER CORP CDA COM*	CAD	2 864			2 864	70 263	0,01	
POWER FINANCIAL CORP COM*	CAD	1 880			1 880	50 341	0,00	
ROGERS COMMS INC CLASS'B'COM CAD1.62478*	CAD	3 009			3 009	149 783	0,01	
ROYAL BK OF CANADA COM NPV*	CAD	12 334	1 095	919	12 510	934 382	0,07	
SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV*	CAD	4 000			4 000	88 880	0,01	
SUN LIFE FINL INC COM*	CAD		5 796		5 796	222 822	0,02	
TRANSCANADA CORP COM NPV*	CAD	6 673	1 053		7 726	368 628	0,03	
Total Kanada						**7 399 806**	**0,55**	
Dänemark								
DANSKE BANK A/S DKK10*	DKK	9 900			9 900	383 182	0,03	
ISS A/S DKK1*	DKK	11 070		11 070				
Total Dänemark						**383 182**	**0,03**	
Finnland								
ELISA CORPORATION EUR0.50*	EUR	16 545	5 451		21 996	916 369	0,07	
FORTUM OYJ EUR3.40*	EUR	35 394		31 394	4 000	77 282	0,01	
KONE CORPORATION NPV ORD 'B'*	EUR	8 347	3 269	8 116	3 500	179 363	0,01	
METSO OYJ NPV*	EUR	3 655	5 974	1 955	7 674	272 477	0,02	
NESTE OIL OYJ NPV*	EUR	4 923	7 400	6 733	5 590	236 272	0,02	
NOKIA OYJ NPV*	EUR	45 870		26 846	19 024	110 548	0,01	
NOKIAN RENKAAT OYJ NPV*	EUR	1 259	3 651		4 910	211 350	0,02	
ORION CORP SER'B'NPV*	EUR	700	7 796	2 509	5 987	268 872	0,02	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SAMPO OYJ SER'A'NPV*	EUR	10 689	3 778	4 518	9 949	508 942	0,04	
STORA ENSO OYJ NPV SER'R'*	EUR	16 331			16 331	223 238	0,02	
UPM-KYMMENE CORP NPV*	EUR	33 056		7 435	25 621	672 027	0,05	
WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50*	EUR	4 401		2 901	1 500	102 779	0,01	
Total Finnland						**3 779 520**	**0,28**	
Frankreich								
AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)*	EUR	3 351			3 351	432 576	0,03	
ATOS SE EUR1*	EUR	3 923			3 923	588 985	0,04	
AXA EUR2.29*	EUR	57 132	1 781		58 913	1 724 520	0,13	
BIC EUR3.82*	EUR	918	336	918	336	38 973	0,00	
BNP PARIBAS EUR2*	EUR	21 331			21 331	1 665 331	0,12	
BOUYGUES EUR1*	EUR	2 808			2 808	128 964	0,01	
CAPGEMINI EUR8*	EUR	2 151	1 249	2 151	1 249	141 673	0,01	
CARREFOUR EUR2.50*	EUR	8 718	10 980	19 698				
CHRISTIAN DIOR EUR2*	EUR	1 968	1 968	3 936				
CHRISTIAN DIOR SE EUR2 (TEMP 28/6/17 SEM C&S)*	EUR		1 968	1 968				
CIE DE ST-GOBAIN EUR4*	EUR	12 066			12 066	695 910	0,05	
CNP ASSURANCES EUR1*	EUR		1 456		1 456	33 027	0,00	
CREDIT AGRICOLE SA EUR3*	EUR	16 337	5 454	4 559	17 232	303 165	0,02	
DANONE EUR0.25*	EUR	7 274			7 274	552 245	0,04	
DASSAULT SYSTEMES EUR0.50*	EUR	4 228			4 228	413 947	0,03	
EDENRED EUR2*	EUR	2 000	6 226		8 226	216 423	0,02	
EIFFAGE EUR4*	EUR	4 730			4 730	473 971	0,04	
ENGIE EUR1*	EUR	22 868		22 868				
ESSILOR INTL EUR0.18*	EUR	3 151			3 151	377 563	0,03	
EURAZEO NPV*	EUR		4 223		4 223	365 344	0,03	
EUTELSAT COMMUNICA EUR1*	EUR	2 899	5 448	2 899	5 448	156 173	0,01	
HERMES INTL NPV*	EUR	327			327	159 553	0,01	
ILIAD NPV*	EUR	110		110				
IMERYS EUR2*	EUR	790			790	69 086	0,01	
INGENICO GROUP EUR1*	EUR	1 714	3 080	3 505	1 289	118 254	0,01	
IPSEN EUR1*	EUR		2 811		2 811	361 582	0,03	
KERING EUR4*	EUR		2 719	440	2 279	878 669	0,07	
KLEPIERRE EUR1.40*	EUR	9 030		2 639	6 391	242 786	0,02	
L'OREAL EUR0.20*	EUR	7 118			7 118	1 464 792	0,11	
LEGRAND SA EUR4*	EUR	5 506			5 506	384 700	0,03	
LVMH MOET HENNESSY EUR0.30*	EUR	5 211			5 211	1 391 559	0,10	
NATIXIS EUR1.6*	EUR	14 631		14 631				
ORANGE EUR4*	EUR	45 024			45 024	713 829	0,05	
PERNOD RICARD EUR1.55*	EUR		3 354		3 354	449 077	0,03	
PEUGEOT SA EUR1*	EUR	14 031			14 031	323 408	0,02	
PUBLICIS GROUPE SA EUR0.40*	EUR	2 411		2 411				
REMY COINTREAU EUR1.60*	EUR		2 747		2 747	314 857	0,02	
RENAULT SA EUR3.81*	EUR	2 990			2 990	284 257	0,02	
SANOFI EUR2*	EUR	28 171	877	691	28 357	2 725 073	0,20	
SCHNEIDER ELECTRIC EUR8*	EUR	15 433	551	2 893	13 091	1 102 591	0,08	
SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)*	EUR	3 472		2 172	1 300	52 754	0,00	
SOC GENERALE EUR1.25*	EUR	15 022			15 022	851 190	0,06	
SODEXO EUR4*	EUR	5 035		1 924	3 111	375 439	0,03	
STMICROELECTRONICS EUR1.04*	EUR		22 519		22 519	421 682	0,03	
SUEZ EUR4*	EUR	4 220		4 220				
THALES EUR3*	EUR	6 395		1 568	4 827	528 858	0,04	
TOTAL EUR2.5*	EUR	54 640	1 647		56 287	2 926 045	0,22	
UNIBAIL-RODAMCO EUR5*	EUR		690		690	162 396	0,01	
VALEO EUR1 (POST SUBD)*	EUR	9 738		1 836	7 902	567 473	0,04	
VEOLIA ENVIRONNEME EUR5*	EUR	13 935		13 935				
VINCI EUR2.50*	EUR	17 816			17 816	1 638 525	0,12	
VIVENDI SA EUR5.50*	EUR	6 275	22 374	12 303	16 346	400 514	0,03	
Total Frankreich						**27 217 740**	**2,04**	
Deutschland								
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1*	EUR	8 456	2 759	2 954	8 261	811 070	0,06	
CECONOMY AG ORD NPV*	EUR	11 945		11 945				
COMMERZBANK AG NPV*	EUR		21 793	21 793				
CONTINENTAL AG ORD NPV*	EUR	1 712			1 712	420 556	0,03	
COVESTRO AG NPV*	EUR	5 471	14 542		20 013	1 665 452	0,12	
DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)*	EUR		3 250		3 250	133 539	0,01	
FRESENIUS MED CARE NPV*	EUR	2 474			2 474	234 239	0,02	
FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV*	EUR	10 216			10 216	797 573	0,06	
HEIDELBERGCEMENT NPV*	EUR	5 670			5 670	564 078	0,04	
HENKEL AG & CO KGAA*	EUR	1 651		1 651				
INNOGY SE NPV*	EUR		1 455		1 455	62 672	0,00	
LANXESS AG NPV*	EUR		7 766	6 035	1 731	132 190	0,01	
LINDE AG NPV*	EUR	1 592		1 592				
METRO WHOLESALE & NPV*	EUR		11 945		11 945	244 378	0,02	
RWE AG (NEU) NPV*	EUR	5 860		5 860				
SAP AG ORD NPV*	EUR	15 215		718	14 497	1 537 085	0,12	
VOLKSWAGEN AG ORD NPV*	EUR	491		491				
Total Deutschland						**6 602 832**	**0,49**	
Hongkong								
BOC HONG KONG HLDG HKD5*	HKD	28 000			28 000	131 636	0,01	
CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0*	HKD	21 750			21 750	269 038	0,02	
CLP HOLDINGS HKD5*	HKD	13 000	49 384		62 384	618 644	0,05	
HANG LUNG PROP HKD1*	HKD	18 000			18 000	41 342	0,00	
HANG SENG BANK HKD5*	HKD	6 000	15 000		21 000	495 327	0,04	
HENDERSON LAND DEV HKD2*	HKD	10 000	1 000		11 000	70 519	0,01	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT*	HKD	40 000			40 000	47 025	0,00	
HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25*	HKD		607 330		607 330	1 104 477	0,08	
I-CABLE COMMUNICAT NPV*	HKD		9 964	6 359	3 605	114	0,00	
NEW WORLD DEVEL CO HKD1*	HKD	43 000			43 000	59 768	0,00	
NWS HOLDINGS LTD HKD1*	HKD	17 000	16 000		33 000	62 221	0,00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1*	HKD	14 500			14 500	121 518	0,01	
SINO LAND CO HKD1*	HKD	32 000			32 000	54 389	0,00	
SUN HUNG KAI PROP NPV*	HKD	16 000			16 000	251 529	0,02	
SWIRE PACIFIC 'A'HKD0.60*	HKD	9 000		9 000				
THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST*	HKD		114 257	114 257				
WHARF(HLDGS) HKD1*	HKD	13 000			13 000	112 088	0,01	
Total Hongkong						**3 439 634**	**0,26**	
Irland								
CRH ORD EUR0.32*	EUR	6 785			6 785	250 497	0,02	
KERRY GROUP 'A'ORD EUR0.125(DUBLIN LIST)*	EUR	2 605		890	1 715	159 473	0,01	
PADDY POWER BETFAI ORD EUR0.09*	EUR	1 493	1 442	1 214	1 721	166 193	0,01	
RYANAIR LTD ORD EUR0.006*	EUR	12 725			12 725	237 555	0,02	
Total Irland						**813 719**	**0,06**	
Italien								
ASSIC GENERALI SPA EUR1*	EUR	18 098		18 098				
ATLANTIA SPA EUR1*	EUR	5 232			5 232	159 856	0,01	
ENEL EUR1*	EUR	179 554			179 554	1 046 468	0,08	
ENI SPA EUR1*	EUR	45 985	15 774	24 729	37 030	593 019	0,04	
FERRARI NV EUR0.01(NEW)*	EUR	3 800			3 800	406 427	0,03	
GEDI GRUPPO EDITOR EUR0.15*	EUR		1 920	1 920				
INTESA SANPAOLO*	EUR	246 567		24 402	222 165	760 368	0,06	
MEDIOBANCA SPA EUR0.5*	EUR	24 861			24 861	258 221	0,02	
POSTE ITALIANE SPA NPV*	EUR	79 933			79 933	569 641	0,04	
PRYSMIAN SPA EUR0.10*	EUR	12 020	6 254	18 274				
RECORDATI EUR0.125*	EUR		12 116		12 116	540 519	0,04	
SAIPEM EUR1*	EUR	285 620		285 620				
SNAM EUR1*	EUR	23 564			23 564	109 868	0,01	
TELECOM ITALIA SPA EUR0.55*	EUR	64 695	711 731	136 268	640 158	580 328	0,04	
TERNA SPA ORD EUR0.22*	EUR	73 375	106 418	44 934	134 859	762 376	0,06	
UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)*	EUR	7 295	17 174	7 295	17 174	354 008	0,03	
Total Italien						**6 141 098**	**0,46**	
Japan								
ASTELLAS PHARMA NPV*	JPY	69 700		26 600	43 100	530 348	0,04	
BENESSE HOLDINGS INC NPV*	JPY	11 400			11 400	397 854	0,03	
BRIDGESTONE CORP NPV*	JPY	5 800			5 800	254 567	0,02	
CANON INC NPV*	JPY	8 400			8 400	277 631	0,02	
CHUGAI PHARM CO NPV*	JPY	9 000		9 000				
DAITO TRUST CONST NPV*	JPY	500			500	88 108	0,01	
EISAI CO NPV*	JPY	10 000			10 000	496 500	0,04	
ITOCHU CORP NPV*	JPY	14 400			14 400	228 129	0,02	
JAPAN AIRLINES CO NPV*	JPY	12 200		10 800	1 400	45 827	0,00	
JAPAN TOBACCO INC NPV*	JPY	9 100			9 100	288 486	0,02	
KEIKYU CORP*	JPY	19 000		19 000				
KIRIN HOLDINGS CO LTD NPV*	JPY	33 500			33 500	762 527	0,06	
LAWSON INC NPV*	JPY	5 535			5 535	354 459	0,03	
MITSUBISHI MOTOR C NPV*	JPY	64 000		64 000				
MITSUBISHI TANABE PHARMA CORP NPV*	JPY	52 653			52 653	1 167 711	0,09	
NIPPON TEL&TEL CP NPV*	JPY	18 883			18 883	837 068	0,06	
NISSAN MOTOR CO NPV*	JPY	22 500			22 500	215 554	0,02	
NISSHIN SEIFUN GRP NPV*	JPY	49 120			49 120	795 907	0,06	
NTT DOCOMO NPV*	JPY	51 500			51 500	1 137 935	0,09	
ORIENTAL LAND CO NPV*	JPY	10 331			10 331	761 410	0,06	
OTSUKA HLDGS CO NPV*	JPY	21 323			21 323	819 493	0,06	
PARK 24 CO LTD NPV*	JPY	3 900			3 900	91 856	0,01	
SEKISUI HOUSE NPV*	JPY	4 600			4 600	74 990	0,01	
SUBARU CORPORATION NPV*	JPY	4 900			4 900	171 007	0,01	
SUNTORY BEVERAGE & NPV*	JPY	20 514	4 100		24 614	1 060 016	0,08	
TAKEDA PHARMACEUTI NPV*	JPY	5 400	900		6 300	336 515	0,03	
TSURUHA HOLDINGS I NPV*	JPY		6 000		6 000	693 691	0,05	
Total Japan						**11 887 588**	**0,89**	
Luxemburg								
ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)*	EUR		18 388	4 961	13 427	335 212	0,03	
Total Luxemburg						**335 212**	**0,03**	
Macau								
SANDS CHINA LTD USD0.01 REG'S'*	HKD	21 600			21 600	108 773	0,01	
Total Macau						**108 773**	**0,01**	
Niederlande								
AKZO NOBEL NV EUR2*	EUR		4 022	3 285	737	65 859	0,00	
ALTICE NV EUR0.01 (COMMON SHARES A)*	EUR	3 135	11 421	3 135	11 421	221 377	0,02	
ALTICE NV EUR0.25 (COMMON SHARES B)*	EUR	2 816		2 816				
ASML HOLDING NV EUR0.09*	EUR	5 572	2 671		8 243	1 358 268	0,10	
EXOR NV EUR0.01*	EUR	1 334	1 946	1 334	1 946	119 426	0,01	
FIAT CHRYSLER AUTO EUR0.01*	EUR	31 812	7 855	10 096	29 571	512 805	0,04	
HEINEKEN NV EUR1.60*	EUR	4 960		4 960				
ING GROEP N.V. EUR0.01*	EUR	85 543		4 129	81 414	1 452 816	0,11	
KON KPN NV EUR0.24*	EUR	51 253		51 253				
KONINKLIJKE AHOLD EUR0.01*	EUR	29 555	3 334	14 069	18 820	340 575	0,03	
KONINKLIJKE BOSKAL EUR0.01*	EUR	1 788	58	1 846				
KONINKLIJKE PHILIPS NV EUR0.20*	EUR	8 000	7 389	7 389	8 000	319 651	0,02	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
NN GROUP N.V. EUR0.12*	EUR		12 147		12 147	492 019	0,04	
RANDSTAD HLDGS NV EUR0.10*	EUR	11 156	448	1 899	9 705	581 053	0,04	
RELX NV EUR0.07*	EUR	40 122	12 731	9 124	43 729	900 886	0,07	
WOLTERS KLUWER EUR0.12*	EUR	4 763			4 763	213 004	0,02	
Total Niederlande						**6 577 739**	**0,49**	
Neuseeland								
FLETCHER BUILDING NPV*	NZD	9 300			9 300	51 976	0,00	
SPARK NEW ZEALAND NPV*	NZD	13 777			13 777	35 174	0,00	
Total Neuseeland						**87 150**	**0,01**	
Norwegen								
GJENSIDIGE FORSIKR NOK2*	NOK	1 625	1 215		2 840	47 846	0,00	
ORKLA ASA NOK1.25*	NOK	6 260	2 050		8 310	82 526	0,01	
YARA INTERNATIONAL NOK1.7*	NOK	1 847		1 847				
Total Norwegen						**130 372**	**0,01**	
Portugal								
GALP ENERGIA EUR1-B*	EUR	3 774	7 383	7 383	3 774	64 734	0,00	
JERONIMO MARTINS EUR5*	EUR	3 964	3 063	3 964	3 063	58 478	0,00	
Total Portugal						**123 212**	**0,01**	
Singapur								
COMFORTDELGRO CORP SGD0.25*	SGD	24 800			24 800	36 756	0,00	
DBS GROUP HLDGS SGD1*	SGD	16 400			16 400	243 297	0,02	
OVERSEA-CHINESE BK NPV*	SGD	24 900			24 900	198 005	0,01	
SINGAPORE EXCHANGE SGD0.01*	SGD	6 500			6 500	34 227	0,00	
SINGAPORE TELECOMM NPV(POST RE-ORG)*	SGD	69 000			69 000	180 929	0,01	
UTD O/S BANK SGD1*	SGD	13 200	237		13 437	225 000	0,02	
Total Singapur						**918 214**	**0,07**	
Spanien								
ABERTIS INFRAESTR EUR3 SERIE A*	EUR		36 014	26 914	9 100	178 002	0,01	
ACS ACTIVIDADES CO EUR0.5*	EUR		9 126	9 126				
AENA SME S.A. EUR10*	EUR	2 748	2 191		4 939	862 993	0,06	
AMADEUS IT GROUP EUR0.01*	EUR	31 627			31 627	1 989 429	0,15	
BCO DE SABADELL EUR0.125*	EUR	47 753		47 753				
DISTRIBUIDORA INTL EUR0.01*	EUR	56 168		37 468	18 700	105 564	0,01	
ENAGAS SA EUR1.50*	EUR	38 567	2 436	8 780	32 223	878 184	0,07	
ENDESA SA EUR1.2*	EUR	46 529			46 529	1 015 255	0,08	
FERROVIAL SA EUR0.2*	EUR	6 523		6 523				
GAS NATURAL SDG EUR1*	EUR	30 950	7 926	35 447	3 429	73 467	0,01	
GRIFOLS SA EUR0.25 (CLASS A) POST SUBD*	EUR	7 332			7 332	206 741	0,02	
IBERDROLA SA EUR0.75 (POST SUBDIVISION)*	EUR	80 806			80 806	607 474	0,05	
INDITEX EUR0.03 (POST SUBD)*	EUR	11 980			11 980	436 948	0,03	
INTL CONS AIRLINE ORD EUR0.50*	EUR	31 295	18 240	31 295	18 240	140 628	0,01	
RED ELECTRICA CORP EUR0.5*	EUR	17 119	1 499		18 618	378 662	0,03	
REPSOL SA EUR1*	EUR	10 320	28 913		39 233	699 656	0,05	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY*	EUR		16 629		16 629	210 096	0,02	
TELEFONICA SA EUR1*	EUR	69 253			69 253	728 174	0,05	
Total Spanien						**8 511 274**	**0,64**	
Schweden								
ELECTROLUX AB SER'B'NPV (POST SPLIT)*	SEK	2 600			2 600	85 252	0,01	
HENNES & MAURITZ SER'B'NPV*	SEK	7 800			7 800	195 100	0,01	
SKANSKA AB SER'B'NPV*	SEK	4 120			4 120	92 162	0,01	
SKF AB SER'B'NPV*	SEK	5 075			5 075	106 786	0,01	
SWEDISH MATCH NPV*	SEK	1 421			1 421	48 127	0,00	
TELIASONERA AB NPV*	SEK	22 428		22 428				
Total Schweden						**527 427**	**0,04**	
Schweiz								
PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)(POST SUBD)*	CHF	11 889			11 889	957 065	0,07	
SIKA AG CHF0.60 (BR)*	CHF	117			117	842 985	0,06	
SWISS RE AG CHF0.10*	CHF	2 690			2 690	235 913	0,02	
Total Schweiz						**2 035 963**	**0,15**	
Grossbritannien								
3I GROUP ORD GBP0.738636*	GBP	7 802	2 686		10 488	124 308	0,01	
ABERDEEN ASSET MGT ORD GBP0.10*	GBP	11 027		11 027				
ADMIRAL GROUP ORD GBP0.001*	GBP	12 424			12 424	293 057	0,02	
ASTRAZENECA ORD USD0.25*	GBP	10 351	841		11 192	719 924	0,05	
BARRATT DEVEL ORD GBP0.10*	GBP	11 104			11 104	88 580	0,01	
BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25*	GBP	15 652	5 543	1 219	19 976	1 211 564	0,09	
BT GROUP ORD GBP0.05*	GBP	72 846			72 846	268 476	0,02	
COMPASS GROUP ORD GBP0.1105*	GBP		39 448		39 448	810 664	0,06	
COMPASS GROUP ORD GBP0.10625*	GBP	41 026		41 026				
DIAGEO ORD GBP0.28 101/108*	GBP	19 921			19 921	634 372	0,05	
DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909*	GBP	15 091			15 091	71 232	0,01	
EASYJET ORD GBP0.27285714*	GBP		3 539		3 539	55 912	0,00	
FRESNILLO PLC ORD USD0.50*	GBP	58 500			58 500	1 067 007	0,08	
GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25*	GBP	37 800		37 800				
IMI ORD GBP0.2857*	GBP	6 355			6 355	102 547	0,01	
IMPERIAL BRANDS PL GBP0.10*	GBP	7 689	466		8 155	337 079	0,03	
INMARSAT ORD EUR0.0005*	GBP	6 000			6 000	50 123	0,00	
INVESTEC ORD GBP0.0002*	GBP	4 923	4 104		9 027	63 867	0,00	
ITV ORD GBP0.10*	GBP	36 923			36 923	83 738	0,01	
KINGFISHER ORD GBP0.157142857*	GBP	21 681			21 681	84 015	0,01	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
LEGAL & GENERAL GP ORD GBP0.025*	GBP	46 605	6 177		52 782	178 085	0,01	
MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25*	GBP	18 776			18 776	86 140	0,01	
MEGGITT ORD GBP0.05*	GBP	17 914			17 914	121 162	0,01	
NATIONAL GRID ORD GBP0.11395*	GBP	30 193		30 193				
NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289*	GBP		29 641		29 641	355 780	0,03	
NEXT ORD GBP0.10*	GBP		1 899		1 899	129 672	0,01	
OLD MUTUAL PLC ORD GBP0.114285714(POST CON*	GBP	40 000		40 000				
PEARSON ORD GBP0.25*	GBP	6 503	3 956		10 459	83 095	0,01	
PERSIMMON ORD GBP0.10*	GBP	2 931			2 931	98 244	0,01	
PETROFAC ORD USD0.02*	GBP	3 124		3 124				
PROVIDENT FINL ORD GBX20.727272*	GBP	1 180		1 180				
RANDGOLD RESOURCES ORD USD0.05*	GBP	4 664	8 230		12 894	1 224 439	0,09	
RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10*	GBP	7 144			7 144	631 851	0,05	
SKY PLC ORD GBP0.50*	GBP	7 920	2 061	9 981				
SMITHS GROUP ORD GBP0.375*	GBP	6 402			6 402	131 064	0,01	
SSE PLC ORD GBP0.50*	GBP	7 934	2 200		10 134	183 786	0,01	
STD LIFE ABERDEEN ORD GBP0.1222222*	GBP	22 225	8 347		30 572	172 047	0,01	
TATE & LYLE ORD GBP0.25*	GBP	40 661	3 549		44 210	372 191	0,03	
UNILEVER PLC ORD GBP0.031111*	GBP	10 894			10 894	610 809	0,05	
VODAFONE GROUP ORD USD0.2095238(POST CONS)*	GBP	223 403	10 909		234 312	635 126	0,05	
WILLIAM HILL ORD GBP0.10*	GBP	14 000		14 000				
WPP PLC ORD GBP0.10*	GBP		12 078		12 078	217 160	0,02	
Total Grossbritannien						**11 297 118**	**0,85**	
Vereinigte Staaten								
3M CO COM*	USD	1 355			1 355	275 199	0,02	
ABBVIE INC COM USD0.01*	USD	13 494	627		14 121	1 214 137	0,09	
AFLAC INC COM USD0.10*	USD	13 071			13 071	1 029 380	0,08	
ALLIANT ENERGY CORP COM*	USD	1 851			1 851	74 453	0,01	
ALTRIA GROUP INC COM USD0.333333*	USD	16 194	1 437	779	16 852	1 034 126	0,08	
AMER ELEC PWR INC COM USD6.50*	USD	4 000	565		4 565	310 257	0,02	
AMEREN CORP COM*	USD	6 104			6 104	341 616	0,03	
ANSYS INC COM*	USD	10 200		6 202	3 998	474 777	0,04	
ARAMARK COM USD0.01*	USD	21 000			21 000	825 179	0,06	
AT&T INC COM USD1*	USD	74 806	4 643	3 481	75 968	2 879 255	0,22	
ATMOS ENERGY CORP COM*	USD		13 833		13 833	1 122 183	0,08	
AUTOZONE INC COM USD0.01*	USD	359		359				
AVALONBAY COMMUNI COM USD0.01*	USD	2 888		2 888				
AXIS CAPITAL HLDGS COM USD0.0125*	USD	16 960			16 960	940 486	0,07	
BARD(CR)INC COM USD0.25*	USD	2 962			2 962	918 563	0,07	
BECTON DICKINSON COM USD1*	USD	414			414	78 495	0,01	
BK OF AMERICA CORP COM USD0.01*	USD	21 700			21 700	532 062	0,04	
BLOCK(H&R)INC COM NPV*	USD	1 665	1 001		2 666	68 308	0,01	
BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01*	USD	3 884			3 884	303 734	0,02	
CA INC COM USD0.10*	USD	2 262	700		2 962	95 668	0,01	
CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375*	USD	7 564			7 564	342 672	0,03	
CDK GLOBAL INC COM USD0.01*	USD	4 800			4 800	293 020	0,02	
CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001*	USD	9 360			9 360	944 346	0,07	
CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1*	USD	13 973			13 973	1 028 893	0,08	
CHURCH & DWIGHT INC COM*	USD	9 778			9 778	458 395	0,03	
CINCINNATI FINL CORP COM*	USD	1 350			1 350	100 020	0,01	
CISCO SYSTEMS COM USD0.001*	USD	41 123	1 914		43 037	1 400 441	0,10	
CLOROX CO DEL COM*	USD	3 019			3 019	385 333	0,03	
CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS'A'*	USD		3 030		3 030	397 790	0,03	
CMS ENERGY CORP COM*	USD	2 500			2 500	112 048	0,01	
COACH INC COM USD0.01*	USD	2 372			2 372	92 449	0,01	
COCA-COLA CO COM USD0.25*	USD	34 022	2 691	1 603	35 110	1 529 099	0,11	
CONSOLIDATED EDISON INC COM*	USD	12 440	374		12 814	1 000 337	0,07	
CONSTELLATION BRDS CLASS'A'COM USD0.01*	USD	3 126			3 126	603 280	0,05	
COOPER COS INC COM USD0.10*	USD	4 315		1 853	2 462	564 851	0,04	
COSTCO WHSL CORP NEW COM*	USD	3 488			3 488	554 477	0,04	
CUMMINS INC COM*	USD	784			784	127 467	0,01	
DARDEN RESTAURANTS INC COM*	USD	6 052			6 052	461 329	0,03	
DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL V*	USD	17 000		9 249	7 751	579 065	0,04	
DOWDUPONT INC COM USD0.01*	USD		21 066		21 066	1 411 147	0,11	
DR PEPPER SNAPPLE COM STK USD0.01*	USD	4 558			4 558	390 181	0,03	
DTE ENERGY CO COM*	USD	8 531			8 531	886 213	0,07	
DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)*	USD	5 725	474		6 199	503 365	0,04	
EMERSON ELEC CO COM*	USD	5 771	1 046		6 817	414 501	0,03	
ENTERGY CORP NEW COM*	USD	1 500		1 500				
EVERSOURCE ENERGY COM USD5*	USD	15 148			15 148	885 881	0,07	
EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01*	USD	5 158			5 158	298 754	0,02	
EXXON MOBIL CORP COM NPV*	USD	44 832	4 276	2 355	46 753	3 708 628	0,28	
GALLAGHER ARTHUR J & CO COM*	USD	1 300	360		1 660	98 863	0,01	
GAP INC DEL COM*	USD	3 006			3 006	85 891	0,01	
GARTNER INC COM*	USD	8 445			8 445	1 016 602	0,08	
GENERAL MLS INC COM*	USD	15 625	586		16 211	811 895	0,06	
GENERAL MOTORS CO COM USD0.01*	USD	11 200	868		12 068	471 517	0,04	
GILEAD SCIENCES COM USD0.001*	USD		11 491		11 491	900 836	0,07	
HESS CORPORATION COM USD1*	USD	7 950		7 950				
HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586*	USD	10 654	18 247		28 901	898 782	0,07	
HP INC COM USD0.01*	USD	14 829	1 614		16 443	317 569	0,02	
HUMANA INC COM USD0.166*	USD	4 734			4 734	1 115 976	0,08	
INTEL CORP COM USD0.001*	USD	39 350	1 831		41 181	1 517 364	0,11	
INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20*	USD	7 501	349		7 850	1 101 978	0,08	
INTL PAPER CO COM*	USD	3 939			3 939	216 562	0,02	
INVESCO LTD COM STK USD0.20*	USD	3 684			3 684	124 905	0,01	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
JOHNSON & JOHNSON COM USD1*	USD	5 202			5 202	654 400	0,05	
JP MORGAN CHASE & COM USD1*	USD	7 400			7 400	683 875	0,05	
KIMBERLY CLARK CORP COM*	USD	2 966	254		3 220	366 652	0,03	
KLA-TENCOR CORP COM USD0.001*	USD	1 373		1 373				
KOHLS CORPORATION COM USD0.01*	USD	1 900			1 900	83 925	0,01	
L BRANDS INC COM USD0.50*	USD	2 016			2 016	81 168	0,01	
LEVEL 3 COMMUNICAT COM USD0.01(POST REV SPLIT)*	USD	5 673			5 673	292 519	0,02	
LYONDELLBASELL IND COM USD0.01*	USD	3 033	346		3 379	323 846	0,02	
MACY'S INC COM STK USD0.01*	USD	2 200	1 316		3 516	74 233	0,01	
MARATHON PETROLEUM COM USD0.01*	USD	4 465	789		5 254	285 098	0,02	
MARSH & MCLENNAN COM USD1*	USD	4 106	10 112		14 218	1 153 002	0,09	
MATTEL INC COM USD1*	USD	2 942	1 925		4 867	72 900	0,01	
MAXIM INTEGRATED COM USD0.001*	USD	2 203	647		2 850	131 568	0,01	
MCDONALD'S CORP COM USD0.01*	USD	15 368	645		16 013	2 427 628	0,18	
MERCK & CO INC COM USD0.50*	USD	22 894	1 064		23 958	1 484 328	0,11	
MOSAIC CO COM USD0.01*	USD	3 199	1 752		4 951	103 429	0,01	
NEWMONT MINING CP COM USD1.60*	USD	21 011	13 314		34 325	1 245 815	0,09	
NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01*	USD	8 703	688	388	9 003	1 276 641	0,10	
NORDSTROM INC COM NPV*	USD		1 356		1 356	61 864	0,00	
OGE ENERGY CORP COM USD0.01*	USD	1 500	6 874		8 374	291 940	0,02	
ONEOK INC*	USD	2 048	2 034		4 082	218 855	0,02	
PACKAGING CORP AMER COM*	USD	1 150	329		1 479	164 116	0,01	
PAYCHEX INC COM*	USD	2 894			2 894	167 902	0,01	
PFIZER INC COM USD0.05*	USD	50 389	4 751	4 346	50 794	1 754 593	0,13	
PG&E CORP COM*	USD	4 217	444		4 661	307 085	0,02	
PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'*	USD	12 882	1 469	881	13 470	1 446 857	0,11	
PHILLIPS 66 COM USD0.01*	USD		4 446		4 446	394 102	0,03	
PINNACLE WEST CAP CORP COM*	USD	900			900	73 638	0,01	
PPL CORP COM USD0.01*	USD	5 676	796		6 472	237 655	0,02	
PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01*	USD	2 500			2 500	155 638	0,01	
PROCTER & GAMBLE COM NPV*	USD	21 231	2 382	1 454	22 159	1 950 707	0,15	
PUBLIC STORAGE COM USD0.10*	USD	2 657			2 657	550 150	0,04	
PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM*	USD	4 313			4 313	193 013	0,01	
QUALCOMM INC COM USD0.0001*	USD	12 419	577		12 996	651 884	0,05	
QUEST DIAGNOSTICS INC COM*	USD	3 819			3 819	346 025	0,03	
REPUBLIC SERVICES COM USD0.01*	USD	9 618			9 618	614 779	0,05	
REYNOLDS AMERICAN COM USD0.0001*	USD	12 345		12 345				
SCANA CORP NEW COM*	USD	5 803			5 803	272 271	0,02	
SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001*	USD		3 118		3 118	100 073	0,01	
SEMPRA ENERGY COM NPV*	USD	1 998			1 998	220 644	0,02	
SOUTHERN CO COM*	USD	7 849	1 285		9 134	434 302	0,03	
STAPLES INC COM STK USD0.0006*	USD		7 599	7 599				
STRYKER CORP COM USD0.10*	USD	8 504			8 504	1 168 607	0,09	
SYNOPSYS INC COM USD0.01*	USD	11 847			11 847	923 128	0,07	
SYSCO CORP COM USD1*	USD	12 308			12 308	642 502	0,05	
T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20*	USD		2 259		2 259	198 144	0,01	
TARGET CORP COM STK USD0.0833*	USD		4 550		4 550	259 796	0,02	
TJX COS INC COM USD1*	USD	3 592			3 592	256 257	0,02	
VALERO ENERGY CORP NEW COM*	USD	3 632	459		4 091	304 524	0,02	
VERIZON COMMUN COM USD0.10*	USD	18 681			18 681	894 568	0,07	
VF CORP COM NPV*	USD		3 204		3 204	197 079	0,01	
VISA INC COM STK USD0.0001*	USD	3 265			3 265	332 476	0,02	
WEC ENERGY GROUP COM USD0.01*	USD	11 024			11 024	669 663	0,05	
WESTERN UN CO COM*	USD	4 509			4 509	83 768	0,01	
XCEL ENERGY INC COM*	USD	16 492	631		17 123	784 008	0,06	
Total Vereinigte Staaten						**68 734 241**	**5,15**	
Total Inhaberaktien						**174 416 635**	**13,07**	
Partizipationsscheine								
Schweiz								
LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10*	CHF	154			154	850 850	0,06	
SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)*	CHF	2 374			2 374	507 799	0,04	
Total Schweiz						**1 358 649**	**0,10**	
Total Partizipationsscheine						**1 358 649**	**0,10**	
Weitere Aktien								
Niederlande								
UNILEVER NV CVA EUR0.16*	EUR	39 231	874		40 105	2 295 634	0,17	
Total Niederlande						**2 295 634**	**0,17**	
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSCHEINE NPV*	CHF	7 384			7 384	1 825 325	0,14	
Total Schweiz						**1 825 325**	**0,14**	
Grossbritannien								
BERKELEY GP HLDGS ORD GBP0.05*	GBP	1 500			1 500	72 380	0,01	
Total Grossbritannien						**72 380**	**0,01**	
Total Weitere Aktien						**4 193 339**	**0,31**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Vorzugsaktien								
Deutschland								
HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV*	EUR	12 186			12 186	1 605 136	0,12	
SCHAEFFLER AG NPV*	EUR	6 057		6 057				
VOLKSWAGEN AG NON VTG PRF NPV*	EUR	986		986				
Total Deutschland						**1 605 136**	**0,12**	
Total Vorzugsaktien						**1 605 136**	**0,12**	
Namensaktien								
Frankreich								
MICHELIN (CGDE) EUR2*	EUR	4 441			4 441	627 386	0,05	
Total Frankreich						**627 386**	**0,05**	
Deutschland								
ADIDAS AG NPV (REGD)*	EUR	2 961			2 961	648 287	0,05	
ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)*	EUR	13 149	342	1 515	11 976	2 602 183	0,19	
BASF SE NPV*	EUR	25 970	209		26 179	2 696 344	0,20	
BAYER AG NPV (REGD)*	EUR	13 335			13 335	1 758 770	0,13	
BRENNTAG AG*	EUR	2 438		2 438				
DAIMLER AG ORD NPV(REGD)*	EUR	26 196	1 562		27 758	2 142 327	0,16	
DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)*	EUR	21 509		12 563	8 946	149 713	0,01	
DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)*	EUR		5 065		5 065	531 353	0,04	
DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)*	EUR	6 240	14 539	10 111	10 668	286 895	0,02	
DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)*	EUR	10 700	8 056		18 756	808 100	0,06	
DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)*	EUR	60 309			60 309	1 088 964	0,08	
E.ON SE NPV*	EUR	17 096			17 096	187 269	0,01	
EVONIK INDUSTRIES NPV*	EUR	3 636		1 421	2 215	76 569	0,01	
HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)*	EUR	1 385			1 385	161 519	0,01	
INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)*	EUR	29 054			29 054	706 904	0,05	
K&S AG NPV*	EUR	2 338		2 338				
MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)*	EUR	3 332			3 332	689 494	0,05	
OSRAM LICHT AG NPV*	EUR		3 147		3 147	243 025	0,02	
PROSIEBENSAT1 MED. NPV*	EUR	11 302			11 302	372 788	0,03	
SIEMENS AG NPV(REGD)*	EUR	18 194	2 354	1 467	19 081	2 601 742	0,19	
TUI AG NPV (REGD)*	GBP		4 805		4 805	78 970	0,01	
UNITED INTERNET AG NPV(REGD)*	EUR	8 360		4 636	3 724	224 367	0,02	
Total Deutschland						**18 055 584**	**1,35**	
Luxemburg								
TENARIS S.A. USD1*	EUR	5 900		5 900				
Total Luxemburg							**0,00**	
Niederlande								
ARCELORMITTAL NPV*	EUR	55 165		55 165				
Total Niederlande							**0,00**	
Portugal								
EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)*	EUR	256 193		45 877	210 316	766 247	0,06	
Total Portugal						**766 247**	**0,06**	
Spanien								
BANCO SANTANDER SA EUR0.50(REGD)*	EUR	223 602		11 093	212 509	1 435 923	0,11	
BANKINTER SA EUR0.3(REGD)*	EUR	33 380		12 273	21 107	193 250	0,01	
BBVA(BILB-VIZ-ARG) EUR0.49*	EUR	100 484	17 650		118 134	1 021 741	0,08	
MAPFRE SA EUR0.10*	EUR	29 062		29 062				
Total Spanien						**2 650 915**	**0,20**	
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF	16 500	1 576		18 076	432 739	0,03	
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	1 471			1 471	110 913	0,01	
BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)*	CHF	3 130	898	511	3 517	538 804	0,04	
BARRY CALLEBAUT AG CHF7.29 (REGD)*	CHF	596			596	884 464	0,07	
EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)*	CHF	1 953			1 953	1 257 732	0,09	
GEBERIT CHF0.10(REGD)*	CHF	1 921		385	1 536	703 642	0,05	
GIVAUDAN AG CHF10*	CHF	83			83	174 881	0,01	
KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	5 481			5 481	982 743	0,07	
LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*	CHF	6 004		4 105	1 899	482 346	0,04	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	33 341	2 155	1 378	34 118	2 766 970	0,21	
NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)*	CHF	18 542	1 720	1 163	19 099	1 583 307	0,12	
PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*	CHF	1 120	576		1 696	1 114 272	0,08	
SGS LTD CHF1(REGD)*	CHF	141	9		150	348 450	0,03	
SONOVA HOLDING AG*	CHF	2 170			2 170	356 531	0,03	
SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)*	CHF	244	87		331	112 904	0,01	
SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)*	CHF	571			571	49 706	0,00	
SWISSCOM AG CHF1(REGD)*	CHF	200			200	99 240	0,01	
SYNGENTA CHF0.1(REGD)*	CHF	781		781				
ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*	CHF	1 263			1 263	373 090	0,03	
Total Schweiz						**12 372 735**	**0,93**	
Vereinigte Staaten								
GARMIN LTD COM CHF10.00*	USD	1 000			1 000	52 221	0,00	
Total Vereinigte Staaten						**52 221**	**0,00**	
Total Namensaktien						**34 525 087**	**2,59**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Depository Receipts								
Frankreich								
SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV*	EUR	9 095	16 822	12 685	13 232	280 168	0,02	
Total Frankreich						**280 168**	**0,02**	
Israel								
TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)*	USD	7 469		7 469				
Total Israel							**0,00**	
Niederlande								
ABN AMRO GROUP NV DR EACH REP SHS*	EUR	19 021		8 419	10 602	307 313	0,02	
Total Niederlande						**307 313**	**0,02**	
Grossbritannien								
BRITISH AMERN TOB PLC SPONSORED ADR*	USD		3 793	3 793				
Total Grossbritannien							**0,00**	
Total Depository Receipts						**587 481**	**0,04**	
Anrechte								
Deutschland								
DEUTSCHE BANK AG RIGHTS 06.04.17*	EUR	21 509		21 509				
Total Deutschland							**0,00**	
Niederlande								
KONINKLIJKE BOSKALIS WES NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 29.05.17*	EUR		1 788	1 788				
Total Niederlande							**0,00**	
Spanien								
ACS ACTIVIDADES CO (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 11.07.17*	EUR		9 126	9 126				
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 19.04.17*	EUR		100 484	100 484				
BANCO SANTANDER SA RIGHTS 20.07.17*	EUR		223 602	223 602				
IBERDROLA SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 19.07.17*	EUR		80 806	80 806				
REPSOL SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 30.06.17*	EUR		22 534	22 534				
Total Spanien							**0,00**	
Schweiz								
LONZA GROUP AG RIGHTS 10.05.17*	CHF		6 004	6 004				
Total Schweiz							**0,00**	
Total Anrechte							**0,00**	
Notes, fester Zins								
EUR								
AT&T INC 3.15000% 17-04.09.36*	EUR		1 230 000	1 230 000				
AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.40000% 12-22.11.22*	EUR	650 000			650 000	879 934	0,07	
BANIJAY GROUP SAS-REG-S 4.00000% 17-01.07.22*	EUR		280 000	280 000				
CAIXABANK SA 3.00000% 13-22.03.18*	EUR	4 300 000		4 300 000				
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 3.50000% 11-15.04.21*	EUR	260 000	80 000		340 000	442 791	0,03	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.50000% 13-15.04.23*	EUR	230 000			230 000	285 325	0,02	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 1.00000% 17-15.09.23*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 263 395	0,09	
NETFLIX INC-REG-S 3.62500% 17-15.05.27*	EUR		1 070 000	1 070 000				
NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24*	EUR		540 000		540 000	624 406	0,05	
NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 3.25000% 17-15.05.24*	EUR		1 210 000	1 210 000				
SILGAN HOLDINGS INC-REG-S 3.25000% 17-15.03.25*	EUR	830 000		830 000				
UNITED GROUP BV-REG-S 4.37500% 17-01.07.22*	EUR		1 210 000		1 210 000	1 418 704	0,11	
Total EUR						**4 914 556**	**0,37**	
GBP								
GOLDMAN SACHS GROUP INC 7.12500% 08-07.08.25*	GBP	600 000			600 000	1 034 016	0,08	
Total GBP						**1 034 016**	**0,08**	
USD								
ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26*	USD	620 000			620 000	601 124	0,05	
ABBVIE INC 4.45000% 16-14.05.46*	USD	600 000			600 000	611 089	0,05	
ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 2.50000% 12-12.01.18*	USD	700 000			700 000	677 229	0,05	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 3.35000% 14-31.07.24*	USD	1 100 000			1 100 000	1 101 406	0,08	
ALLERGAN FUNDING SCS 3.45000% 15-15.03.22*	USD	560 000			560 000	561 858	0,04	
AMAZON.COM INC 3.30000% 14-05.12.21*	USD	920 000		920 000				
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.90000% 16-01.04.26*	USD	1 700 000	1 100 000	1 700 000	1 100 000	1 108 182	0,08	
AMERICAN TOWER CORP 3.45000% 14-15.09.21*	USD	800 000			800 000	801 054	0,06	
AMGEN INC 2.65000% 17-11.05.22*	USD		1 120 000		1 120 000	1 092 561	0,08	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 17-11.09.24*	USD		810 000		810 000	781 800	0,06	
ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE INC 4.90000% 16-01.02.46*	USD	810 000		810 000				
APPALACHIAN POWER CO 3.30000% 17-01.06.27*	USD		310 000	310 000				
APPLE INC 4.25000% 17-09.02.47*	USD	710 000			710 000	738 934	0,06	
ARROW ELECTRONICS INC 3.87500% 17-12.01.28*	USD		700 000		700 000	675 873	0,05	
ASTRAZENECA PLC 4.37500% 15-16.11.45*	USD	460 000			460 000	472 459	0,04	
AT&T INC 3.00000% 15-30.06.22*	USD	1 000 000		1 000 000				
AT&T INC 4.25000% 17-01.03.27*	USD		1 400 000		1 400 000	1 394 303	0,10	
BAXTER INTERNATIONAL INC 3.50000% 16-15.08.46*	USD	1 200 000		1 200 000				
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 2.35000% 14-04.03.19*	USD	1 800 000			1 800 000	1 751 520	0,13	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 3.25000% 17-27.02.27*	USD	920 000			920 000	914 145	0,07	
CALATLANTIC GROUP INC 5.00000% 17-15.06.27*	USD		805 000	805 000				
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 4.95000% 17-01.06.47*	USD		430 000		430 000	436 251	0,03	
CARDINAL HEALTH INC 4.36800% 17-15.06.47*	USD		710 000		710 000	703 435	0,05	
CHEVRON CORP 2.49800% 17-03.03.22*	USD	760 000			760 000	741 483	0,06	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
CISCO SYSTEMS INC 2.60000% 16-28.02.23*	USD	710 000			710 000	694 497	0,05	
CITIGROUP INC 4.65000% 15-30.07.45*	USD	804 000		804 000				
CITIGROUP INC-SUB 4.12500% 16-25.07.28*	USD	1 300 000			1 300 000	1 294 283	0,10	
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC 3.30000% 16-01.06.20*	USD	420 000			420 000	415 963	0,03	
CONOCOPHILLIPS CO 3.35000% 15-15.05.25*	USD	1 200 000			1 200 000	1 187 594	0,09	
CONOCOPHILLIPS CO 4.20000% 16-15.03.21*	USD	560 000			560 000	576 256	0,04	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 3.57400% 17-09.01.23*	USD	1 070 000			1 070 000	1 060 238	0,08	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 2.25000% 16-01.09.21*	USD	450 000			450 000	429 413	0,03	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-REG-S 2.82000% 17-19.01.22*	USD	1 700 000		700 000	1 000 000	972 872	0,07	
DOLLAR GENERAL CORP 3.87500% 17-15.04.27*	USD		570 000	570 000				
DOMINION ENERGY INC 2.00000% 16-15.08.21*	USD	716 000			716 000	681 330	0,05	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC 4.42000% 16-15.12.46*	USD	700 000			700 000	710 908	0,05	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 5.12500% 09-07.10.19*	USD	1 300 000		1 300 000				
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 2.85000% 16-15.04.21*	USD	650 000			650 000	638 794	0,05	
EXELON CORP 4.45000% 16-15.04.46*	USD	600 000			600 000	607 976	0,05	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO 3.40000% 16-01.03.27*	USD	920 000	260 000		1 180 000	1 125 596	0,08	
EXXON MOBIL CORP 2.70900% 15-06.03.25*	USD	1 200 000			1 200 000	1 165 825	0,09	
FEDEX CORP 4.75000% 15-15.11.45*	USD	950 000			950 000	1 001 086	0,08	
FORD MOTOR CO 4.34600% 16-08.12.26*	USD	900 000			900 000	905 304	0,07	
GE CAPITAL INTL FUNDING CO 4.41800% 16-15.11.35*	USD	642 000			642 000	675 491	0,05	
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.40000% 16-09.05.19*	USD	1 000 000		1 000 000				
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.95000% 17-13.04.24*	USD		900 000		900 000	891 918	0,07	
GLENCORE FUNDING LLC-REG-S 4.00000% 17-27.03.27*	USD	2 200 000			2 200 000	2 141 607	0,16	
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26*	USD	2 150 000		1 000 000	1 150 000	1 115 754	0,08	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-05.10.18*	USD	2 000 000		2 000 000				
HOME DEPOT INC/THE 5.87500% 06-16.12.36*	USD	500 000			500 000	628 412	0,05	
HUTCHISON WHAMPOA INTL LTD-REG-S 5.75000% 09-11.09.19*	USD	750 000		750 000				
IBM CREDIT LLC 2.20000% 17-08.09.22*	USD		1 500 000		1 500 000	1 439 432	0,11	
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 15-21.07.22*	USD	1 000 000			1 000 000	1 006 077	0,08	
INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24*	USD		1 210 000		1 210 000	1 185 118	0,09	
JPMORGAN CHASE & CO 3.30000% 16-01.04.26*	USD	849 000		849 000				
JPMORGAN CHASE & CO 2.95000% 16-01.10.26*	USD	1 900 000			1 900 000	1 799 287	0,13	
KELLOGG CO 2.65000% 16-01.12.23*	USD	970 000			970 000	932 544	0,07	
KEYBANK NA/CLEVELAND OH-SUB 3.40000% 16-20.05.26*	USD	1 000 000		1 000 000				
KIMBERLY-CLARK CORP 3.20000% 16-30.07.46*	USD	460 000			460 000	403 777	0,03	
KOREA EAST-WEST POWER CO LTD-REG-S 2.50000% 14-02.06.20*	USD	1 000 000			1 000 000	962 622	0,07	
KOREA GAS CORP-REG-S 3.87500% 14-12.02.24*	USD	1 100 000		1 100 000				
LINCOLN NATIONAL CORP 6.30000% 07-09.10.37*	USD	400 000			400 000	478 660	0,04	
MEDTRONIC INC 3.15000% 15-15.03.22*	USD	1 000 000			1 000 000	1 001 903	0,08	
MERCK & CO INC 4.15000% 13-18.05.43*	USD	1 100 000			1 100 000	1 157 786	0,09	
METLIFE INC 4.60000% 15-13.05.46*	USD	1 020 000			1 020 000	1 086 262	0,08	
MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24*	USD	1 150 000			1 150 000	1 137 131	0,09	
MICROSOFT CORP 3.45000% 16-08.08.36*	USD	770 000			770 000	750 438	0,06	
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.99800% 17-22.02.22*	USD	810 000		810 000				
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.95300% 17-28.02.22*	USD	2 100 000		1 000 000	1 100 000	1 072 939	0,08	
MOLSON COORS BREWING CO 3.00000% 16-15.07.26*	USD	259 000		259 000				
MORGAN STANLEY 2.62500% 16-17.11.21*	USD	570 000			570 000	553 497	0,04	
MPLX LP 4.12500% 17-01.03.27*	USD	510 000		510 000				
NEWELL BRANDS INC 5.50000% 16-01.04.46*	USD	465 000			465 000	532 191	0,04	
NIKE INC 2.37500% 16-01.11.26*	USD	1 220 000			1 220 000	1 119 966	0,08	
NIKE INC 3.87500% 15-01.11.45*	USD	380 000			380 000	371 679	0,03	
NVIDIA CORP 2.20000% 16-16.09.21*	USD	430 000			430 000	413 989	0,03	
ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 13-09.10.18*	USD	900 000			900 000	880 384	0,07	
PEPSICO INC 3.10000% 15-17.07.22*	USD	1 000 000			1 000 000	1 004 408	0,08	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC 4.00000% 16-15.12.26*	USD	1 100 000			1 100 000	1 110 040	0,08	
PPL CAPITAL FUNDING INC 3.95000% 14-15.03.24*	USD	1 000 000			1 000 000	1 013 129	0,08	
QUALCOMM INC 2.90000% 17-20.05.24*	USD		1 385 000		1 385 000	1 344 657	0,10	
ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.35000% 14-30.09.24*	USD	1 000 000			1 000 000	1 003 001	0,08	
SANTANDER HOLDINGS USA INC 2.70000% 16-24.05.19*	USD	1 210 000			1 210 000	1 180 031	0,09	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.75000% 16-12.09.46*	USD	1 570 000			1 570 000	1 463 520	0,11	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 3.30000% 16-15.09.46*	USD	1 230 000			1 230 000	1 093 338	0,08	
SIMON PROPERTY GROUP LP 4.25000% 16-30.11.46*	USD	860 000		860 000				
SINOPEC GROUP OVERSEA DEVELOPMENT-REG-S 2.00000% 16-29.09.21*	USD	2 200 000			2 200 000	2 078 401	0,16	
SOLVAY FINANCE AMERICA LLC-REG-S 4.45000% 15-03.12.25*	USD	510 000			510 000	530 389	0,04	
STATOIL ASA 2.90000% 13-08.11.20*	USD	400 000			400 000	396 191	0,03	
SYSCO CORP 3.30000% 16-15.07.26*	USD	417 000			417 000	404 293	0,03	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 5.30000% 13-01.02.44*	USD	1 000 000			1 000 000	1 133 833	0,08	
TIME WARNER INC 3.80000% 16-15.02.27*	USD	690 000			690 000	667 800	0,05	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.90000% 17-17.04.24*	USD		1 640 000		1 640 000	1 614 156	0,12	
TYSON FOODS INC 3.55000% 17-02.06.27*	USD		980 000		980 000	961 735	0,07	
TYSON FOODS INC 3.95000% 14-15.08.24*	USD	400 000		400 000				
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG-144A 4.25300% 17-23.03.28*	USD	1 900 000			1 900 000	1 928 535	0,14	
UBS GROUP FUNDING SWISS AG-REG-S 2.65000% 16-01.02.22*	USD	1 800 000			1 800 000	1 734 832	0,13	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.45000% 16-15.01.27*	USD	480 000			480 000	480 718	0,04	
VALERO ENERGY CORP 3.40000% 16-15.09.26*	USD	670 000			670 000	639 551	0,05	
VALERO ENERGY PARTNERS LP 4.37500% 16-15.12.26*	USD	900 000			900 000	898 680	0,07	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.15000% 14-15.03.24*	USD		1 100 000		1 100 000	1 126 876	0,08	
VIMPELCOM HOLDINGS-REG-S 3.95000% 17-16.06.21*	USD		1 490 000	1 490 000				
VISA INC 4.30000% 15-14.12.45*	USD	1 140 000			1 140 000	1 220 697	0,09	
WELLS FARGO & CO 3.06900% 17-24.01.23*	USD	1 920 000			1 920 000	1 889 620	0,14	
WILLIAMS PARTNERS LP 4.30000% 14-04.03.24*	USD	900 000			900 000	918 668	0,07	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.55000% 15-01.04.25*	USD	490 000			490 000	478 730	0,04	
Total USD						**80 687 329**	**6,05**	
Total Notes, fester Zins						**86 635 901**	**6,49**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Notes, variabler Zins								
EUR								
BG ENERGY CAPITAL PLC-SUB 6.50000%VAR 12-30.11.72*	EUR	850 000			850 000	982 006	0,07	
Total EUR						**982 006**	**0,07**	
USD								
ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.400%/VAR 17-27.03.28*	USD	800 000			800 000	798 518	0,06	
JPMORGAN CHASE & CO 4.260%/3M LIBOR+158BP 17-22.02.48*	USD	1 300 000		1 300 000				
TRANSCANADA TRUST-SUB 5.300%/3M LIBOR+320.8BP 17-15.03.77*	USD	690 000			690 000	683 501	0,05	
Total USD						**1 482 018**	**0,11**	
Total Notes, variabler Zins						**2 464 024**	**0,18**	
Medium-Term Notes, fester Zins								
EUR								
AIB MORTGAGE BANK-REG-S 0.87500% 16-04.02.23*	EUR	3 110 000			3 110 000	3 678 972	0,28	
AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY AB-REG-S 1.75000% 17-07.02.25*	EUR		890 000		890 000	1 024 940	0,08	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 1.62500% 17-18.09.25*	EUR		380 000		380 000	432 190	0,03	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/NZ-REG-S 0.40000% 17-01.03.22*	EUR	820 000			820 000	938 811	0,07	
ARKEMA SA-REG-S 1.50000% 17-20.04.27*	EUR		700 000	700 000				
ATF NETHERLANDS BV-REG-S 1.87500% 17-19.01.26*	EUR		1 100 000		1 100 000	1 253 631	0,09	
ATLANTIA SPA-REG-S 1.62500% 17-03.02.25*	EUR	670 000		670 000				
ATLANTIA SPA-REG-S 1.87500% 17-13.07.27*	EUR		640 000	640 000				
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S 3.62500% 12-18.07.22*	EUR	2 160 000			2 160 000	2 873 338	0,22	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-REG-S-144A 3.50000% 05-15.09.21*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 319 451	0,10	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 1.95000% 12-18.06.19*	EUR	550 000			550 000	656 486	0,05	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.15000% 12-20.06.44*	EUR	500 000			500 000	784 650	0,06	
AUTOROUTES DU SUD DE LA FRANCE SA-REG-S 1.25000% 17-18.01.27*	EUR	700 000		700 000				
AXA BANK EUROPE SCF-REG-S 0.12500% 17-14.03.22*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 376 465	0,10	
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL 4.25000% 06-25.10.23*	EUR	2 600 000			2 600 000	3 625 197	0,27	
BANCO POPULAR ESPANOL SA 4.12500% 10-09.04.18*	EUR	2 250 000			2 250 000	2 631 549	0,20	
BANK OF IRELAND MORTGAGE BANK-REG-S 0.37500% 15-07.05.22*	EUR	3 200 000			3 200 000	3 697 660	0,28	
BARCLAYS BANK PLC 4.00000% 11-12.01.21*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 943 898	0,15	
BNP PARIBAS SA-REG-S 1.00000% 17-27.06.24*	EUR		1 130 000		1 130 000	1 290 070	0,10	
BPCE SOCIETE DE FINANCEMENT DE LHABITAT 2.37500% 13-29.11.23*	EUR	2 200 000			2 200 000	2 829 962	0,21	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 4.00000% 11-10.01.22*	EUR	1 740 000			1 740 000	2 335 990	0,18	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 2.40000% 13-17.01.25*	EUR	3 670 000			3 670 000	4 781 553	0,36	
CAISSE FRANCAISE DE FIN LOCAL 4.87500% 09-02.06.21*	EUR	1 670 000			1 670 000	2 258 939	0,17	
CAISSE FRANCAISE DE FIN LOCAL-REG-S 3.00000% 13-02.10.28*	EUR	2 100 000			2 100 000	2 888 817	0,22	
CAJAMAR CAJA RURAL SCC 3.75000% 13-22.11.18*	EUR	4 100 000			4 100 000	4 893 944	0,37	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAD-REG-S 1.25000% 13-07.08.18*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 478 087	0,26	
CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 1.86500% 17-13.06.22*	EUR		600 000	600 000				
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 16-26.10.23*	EUR	1 090 000		1 090 000				
COMMERZBANK AG-REG-S 1.12500% 17-24.05.24*	EUR		980 000	980 000				
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3.00000% 12-03.05.22*	EUR	3 400 000			3 400 000	4 391 818	0,33	
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 3.87500% 06-25.04.55*	EUR	150 000			150 000	238 511	0,02	
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER-REG-S 0.25000% 16-16.03.22*	EUR	2 100 000			2 100 000	2 423 707	0,18	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.37500% 15-21.10.21*	EUR	2 854 000			2 854 000	3 324 980	0,25	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 16-23.02.24*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 270 795	0,17	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.75000% 17-05.05.27*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 476 463	0,11	
CREDIT SUISSE/GUERNSEY 2.87500% 11-18.10.18*	EUR	2 880 000			2 880 000	3 403 402	0,26	
CREDIT SUISSE/GUERNSEY-REG-S 1.00000% 14-12.03.19*	EUR	1 600 000			1 600 000	1 863 582	0,14	
DANSKE BANK AS 1.62500% 13-28.02.20*	EUR	2 900 000			2 900 000	3 465 584	0,26	
DANSKE BANK AS 3.75000% 10-23.06.22*	EUR	2 400 000			2 400 000	3 215 768	0,24	
DANSKE BANK AS-REG-S 0.12500% 16-09.03.21*	EUR	1 330 000			1 330 000	1 532 215	0,11	
DEUTSCHE APOTHEKER-UND AERZTEBANK EG 0.12500% 15-11.02.21*	EUR	2 600 000			2 600 000	2 997 151	0,22	
DEUTSCHE BANK AG 1.00000% 16-18.03.19*	EUR	1 400 000		1 400 000				
DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26*	EUR	600 000			600 000	769 701	0,06	
DNB BOLIGKREDITT AS 3.87500% 11-16.06.21*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 309 842	0,10	
DNB BOLIGKREDITT AS-REG-S 0.05000% 17-11.01.22*	EUR	2 750 000			2 750 000	3 145 213	0,24	
E.ON SE-REG-S 1.62500% 17-22.05.29*	EUR		1 330 000	1 330 000				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.00000% 17-16.09.24*	EUR	1 000 000		1 000 000				
ENGIE SA-REG-S 1.37500% 17-28.02.29*	EUR		1 400 000		1 400 000	1 596 299	0,12	
ENGIE SA-REG-S 2.00000% 17-28.09.37*	EUR		600 000	600 000				
ERSTE GROUP BANK AG 3.00000% 11-06.09.18*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 358 463	0,18	
FCA BANK SPA/IRELAND-REG-S 1.00000% 17-15.11.21*	EUR		790 000	790 000				
FINLAND, REPUBLIC OF 3.37500% 10-15.04.20*	EUR	450 000			450 000	566 033	0,04	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.37500% 17-15.04.47*	EUR	100 000			100 000	113 730	0,01	
GAS NATURAL CAPITAL MARKETS SA-REG-S 1.12500% 17-11.04.24*	EUR		900 000	900 000				
HEIDELBERGCEMENT FIN LUX SA-REG-S 1.62500% 17-07.04.26*	EUR		900 000	900 000				
HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S 1.75000% 17-29.08.29*	EUR		920 000		920 000	1 034 221	0,08	
IBERCAJA BANCO SA-REG-S 0.25000% 16-18.10.23*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 354 255	0,10	
IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S 1.12500% 16-21.04.26*	EUR	700 000		700 000				
IMERYS SA-REG-S 1.50000% 17-15.01.27*	EUR	700 000		700 000				
ITALGAS SPA-REG-S 0.50000% 17-19.01.22*	EUR	810 000			810 000	933 311	0,07	
JOHN DEERE CASH MANAGEMENT-REG-S 0.50000% 17-15.09.23*	EUR		850 000	850 000				
KBC GROUP NV-REG-S 0.75000% 16-18.10.23*	EUR	600 000			600 000	682 941	0,05	
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 0.20000% 17-10.01.24*	EUR	1 310 000			1 310 000	1 499 344	0,11	
LANSFORSAKRINGAR HYPOTEK AB 1.50000% 14-18.03.21*	EUR	5 000 000			5 000 000	6 021 987	0,45	
LANSFORSAKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.25000% 16-12.04.23*	EUR	1 625 000			1 625 000	1 853 479	0,14	
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 0.75000% 16-09.11.21*	EUR	782 000			782 000	908 786	0,07	
LONDON STOCK EX GROUP PLC-REG-S 0.87500% 17-19.09.24*	EUR		350 000		350 000	399 443	0,03	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.75000% 17-26.05.24*	EUR		890 000		890 000	1 026 426	0,08	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MADRILENA RED DE GAS FINANCE BV-REG-S 1.37500% 17-11.04.25*	EUR		940 000	420 000	520 000	598 104	0,04	
MITSUBISHI UF FINANCIAL GROUP INC-REG-S 0.87200% 17-07.09.24*	EUR		920 000		920 000	1 044 955	0,08	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.87500% 12-13.01.23*	EUR	3 160 000			3 160 000	3 913 072	0,29	
NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC-REG-S 1.00000% 17-12.07.24*	EUR		400 000		400 000	459 517	0,03	
NN GROUP NV-REG-S 0.87500% 17-13.01.23*	EUR	570 000		570 000				
NN GROUP NV-REG-S 1.62500% 17-01.06.27*	EUR		1 160 000		1 160 000	1 345 563	0,10	
NOMURA EUROPE FINANCE NV-REG-S 1.12500% 15-03.06.20*	EUR	1 000 000		1 000 000				
NORDDEUTSCHE LANDESBANK GIROZENTRALE 1.62500% 12-17.07.17*	EUR	4 200 000		4 200 000				
NORDEA BANK AB-REG-S 1.12500% 17-27.09.27*	EUR		1 280 000		1 280 000	1 460 644	0,11	
NORTEGAS ENERGIA DISTRIBUCION SAU-REG-S 0.91800% 17-28.09.22*	EUR		580 000		580 000	665 185	0,05	
NORTEGAS ENERGIA DISTRIBUCION SAU-REG-S 2.06500% 17-28.09.27*	EUR		720 000		720 000	827 271	0,06	
NTPC LTD-REG-S 2.75000% 17-01.02.27*	EUR	520 000			520 000	618 016	0,05	
ORANGE SA-REG-S 1.00000% 16-12.05.25*	EUR	600 000		600 000				
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 17-31.05.24*	EUR		2 000 000		2 000 000	2 271 459	0,17	
RCI BANQUE SA-REG-S 1.62500% 17-11.04.25*	EUR		1 500 000	500 000	1 000 000	1 170 126	0,09	
RCI BANQUE SA-REG-S 0.75000% 17-26.09.22*	EUR		660 000	660 000				
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.75000% 14-19.06.19*	EUR	3 080 000			3 080 000	3 586 866	0,27	
ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC 3.87500% 10-19.10.20*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 921 163	0,14	
RTE EDF TRANSPORT SA-REG-S 2.00000% 16-18.04.36*	EUR	400 000		400 000				
SAMPO OYJ-REG-S 1.25000% 17-30.05.25*	EUR		620 000		620 000	717 790	0,05	
SANOFI-REG-S 1.12500% 16-05.04.28*	EUR	500 000		500 000				
SANTANDER ISSUANCES SAU-REG-S-SUB 3.12500% 17-19.01.27*	EUR	900 000			900 000	1 094 592	0,08	
SCA HYGIENE AB-REG-S 1.12500% 17-27.03.24*	EUR	420 000		420 000				
SCA HYGIENE AB-REG-S 0.62500% 17-28.03.22*	EUR	800 000			800 000	920 928	0,07	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 4.12500% 11-07.04.21*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 938 963	0,30	
SPAREBANKEN 1 BOLIGKREDITT-REG-S 1.50000% 13-20.01.20*	EUR	2 890 000			2 890 000	3 438 162	0,26	
SPAREBANKEN VEST BOLIGKREDITT AS 1.50000% 13-11.09.18*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 491 916	0,26	
SPAREBANKEN VEST BOLIGKREDITT AS-REG-S 0.37500% 15-22.09.20*	EUR	2 538 000			2 538 000	2 946 700	0,22	
SPAREBANKEN VEST BOLIGKREDITT AS-REG-S 0.12500% 16-02.03.21*	EUR	3 200 000			3 200 000	3 681 298	0,28	
SR-BOLIGKREDITT AS 0.12500% 16-08.09.21*	EUR	1 250 000			1 250 000	1 434 661	0,11	
SSE PLC-REG-S 0.87500% 17-06.09.25*	EUR		1 050 000		1 050 000	1 189 249	0,09	
STADSHYPOTEK AB-REG-S 1.62500% 13-30.10.20*	EUR	2 660 000			2 660 000	3 209 874	0,24	
STE AUTOROUTES PARIS RHIN RHONE-REG-S 1.12500% 16-09.01.26*	EUR	800 000		800 000				
SWEDBANK HYPOTEK AB 1.12500% 14-21.05.21*	EUR	2 400 000			2 400 000	2 862 798	0,21	
SWEDISH COVERED BOND CORP-REG-S 0.62500% 14-07.10.21*	EUR	2 300 000			2 300 000	2 696 421	0,20	
TELEFONICA EMISIONES SAU-REG-S 2.31800% 17-17.10.28*	EUR	1 200 000		1 200 000				
TENNET HOLDING BV-REG-S 1.00000% 16-13.06.26*	EUR	940 000			940 000	1 076 930	0,08	
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONAL SPA-REG-S 1.00000% 16-11.10.28*	EUR	830 000		830 000				
TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD-REG-S 1.75000% 17-29.03.28*	EUR		590 000		590 000	678 091	0,05	
UBS AG LONDON-REG-S 1.37500% 14-16.04.21*	EUR	3 060 000			3 060 000	3 669 705	0,27	
UNICREDIT BANK AG 0.50000% 17-04.05.26*	EUR		2 000 000		2 000 000	2 260 203	0,17	
UNICREDIT BANK AG-REG-S 1.87500% 14-09.04.24*	EUR	2 240 000			2 240 000	2 817 818	0,21	
VEOLIA ENVIRONNEMENT-REG-S 0.67200% 17-30.03.22*	EUR	1 100 000		1 100 000				
VONOVIA FINANCE BV-REG-S 1.62500% 15-15.12.20*	EUR	700 000		700 000				
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.50000% 14-24.03.21*	EUR	2 760 000			2 760 000	3 321 832	0,25	
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.37500% 17-05.03.23*	EUR		1 550 000		1 550 000	1 756 391	0,13	
WL-BANK WESTF LANDSCHAFT BODENKB-REG-S 0.87500% 15-18.01.30*	EUR	1 700 000			1 700 000	1 895 834	0,14	
WL-BANK WESTF LANDSCHAFT BODENKB 0.50000% 15-01.04.27*	EUR	2 700 000			2 700 000	3 026 658	0,23	
YORKSHIRE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.25000% 14-11.06.21*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 771 559	0,36	
Total EUR						**183 952 360**	**13,78**	
GBP								
ANHEUSER-BUSCH NORTH AMERICAN HLD-REG-S 2.25000% 17-24.05.29*	GBP		880 000	880 000				
AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 6.25000% 04-09.06.22*	GBP	600 000		600 000				
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.17700% 16-12.08.23*	GBP	910 000			910 000	1 139 253	0,09	
COMPASS GROUP PLC-REG-S 3.85000% 14-26.06.26*	GBP	500 000		500 000				
COMPASS GROUP PLC-REG-S 2.00000% 17-03.07.29*	GBP		550 000		550 000	691 094	0,05	
CRH FINANCE UK PLC-REG-S 4.12500% 15-02.12.29*	GBP		900 000		900 000	1 322 154	0,10	
DS SMITH PLC-REG-S 2.87500% 17-26.07.29*	GBP		353 000		353 000	447 090	0,03	
KONINKLIJKE KPN NV 5.75000% 09-17.09.29*	GBP	700 000			700 000	1 146 295	0,09	
KONINKLIJKE KPN NV 5.00000% 11-18.11.26*	GBP	1 200 000		500 000	700 000	1 070 952	0,08	
MORGAN STANLEY 2.62500% 17-09.03.27*	GBP	620 000			620 000	802 224	0,06	
NATIONAL GRID GAS FINANCE PLC-REG-S 2.12500% 16-22.09.28*	GBP	780 000		780 000				
PLACES FOR PEOPLE TREASURY PLC-REG-S 2.87500% 16-17.08.26*	GBP		500 000		500 000	634 616	0,05	
Total GBP						**7 253 678**	**0,54**	
USD								
ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.87500% 16-PRP*	USD	1 200 000		1 200 000				
BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.20000% 14-26.08.24*	USD	800 000			800 000	814 125	0,06	
BANK OF AMERICA NA 2.05000% 15-07.12.18*	USD	1 500 000		1 500 000				
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.00000% 16-12.04.19*	USD	900 000		900 000				
GENERAL ELECTRIC CO-REG-S 4.62500% 13-30.01.43*	USD	2 000 000			2 000 000	1 944 934	0,15	
KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 2.37500% 14-28.10.19*	USD	1 000 000			1 000 000	964 378	0,07	
MCDONALD'S CORP 4.87500% 15-09.12.45*	USD	1 200 000			1 200 000	1 307 060	0,10	
MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26*	USD	1 100 000		1 100 000				
PRUDENTIAL PLC-REG-S-SUB 5.25000% 16-PRP*	USD	430 000			430 000	428 812	0,03	
QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S 3.00000% 17-21.10.22*	USD		1 960 000	960 000	1 000 000	961 349	0,07	
SOCIETE GENERALE-REG-S 2.62500% 15-16.09.20*	USD	1 000 000			1 000 000	976 395	0,07	
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 2.75000% 17-04.05.22*	USD		2 000 000		2 000 000	1 939 484	0,15	
SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.44200% 16-19.10.21*	USD	1 030 000			1 030 000	991 416	0,07	
US BANCORP 2.62500% 17-24.01.22*	USD	610 000			610 000	598 463	0,04	
WALT DISNEY CO/THE 3.70000% 12-01.12.42*	USD	650 000			650 000	612 386	0,05	
WELLS FARGO & CO-SUB 4.90000% 15-17.11.45*	USD	500 000			500 000	539 652	0,04	
Total USD						**12 078 455**	**0,90**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**203 284 492**	**15,23**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Medium-Term Notes, variabler Zins								
EUR								
CAIXABANK SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 17-14.07.28*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 508 048	0,11	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 1.250%/VAR 17-17.07.25*	EUR		1 110 000	610 000	500 000	572 701	0,04	
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27*	EUR		900 000		900 000	1 031 762	0,08	
DNB BANK ASA-REG-S-SUB 1.250%/VAR 17-01.03.27*	EUR	570 000		570 000				
ING GROEP NV-REG-S-SUB 1.625%/VAR 17-26.09.29*	EUR		500 000		500 000	567 304	0,04	
KBC GROEP NV-REG-S-SUB 1.875%/VAR 15-11.03.27*	EUR	700 000			700 000	823 124	0,06	
KBC GROUP NV-REG-S-SUB 1.625%/VAR 17-18.09.29*	EUR		500 000	500 000				
NORDEA BANK AB-REG-S-SUB 1.000%/VAR 16-07.09.26*	EUR	670 000			670 000	772 282	0,06	
OMV AG-SUB 6.750%/VAR 11-PRP*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 184 974	0,09	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-REG-S-SUB 1.375%/VAR 16-31.10.28*	EUR	880 000		880 000				
TOTAL SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP*	EUR	279 000		279 000				
Total EUR						**6 460 195**	**0,48**	
USD								
BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 17-19.09.27*	USD		480 000		480 000	461 541	0,03	
DIANJIAN HAIYU LTD-REG-S 3.500%/VAR 17-PRP*	USD		550 000	550 000				
Total USD						**461 541**	**0,03**	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						**6 921 735**	**0,52**	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
SWITZERLAND 1.25000% 12-11.06.24*	CHF	6 700 000	500 000		7 200 000	7 962 480	0,60	
SWITZERLAND 1.25000% 12-27.06.37*	CHF	7 800 000			7 800 000	9 110 400	0,68	
SWITZERLAND 1.25000% 14-28.05.26*	CHF	3 800 000	900 000		4 700 000	5 256 950	0,39	
SWITZERLAND 1.50000% 12-30.04.42*	CHF	7 750 000	500 000		8 250 000	10 370 250	0,78	
SWITZERLAND 1.50000% 13-24.07.25*	CHF	5 900 000			5 900 000	6 687 650	0,50	
SWITZERLAND 2.00000% 10-28.04.21*	CHF	9 000 000			9 000 000	9 852 300	0,74	
SWITZERLAND 2.00000% 11-25.05.22*	CHF	7 850 000	250 000		8 100 000	9 054 990	0,68	
SWITZERLAND 2.00000% 14-25.06.64*	CHF	4 600 000	550 000		5 150 000	8 234 850	0,62	
SWITZERLAND 2.25000% 05-06.07.20*	CHF	9 200 000	500 000		9 700 000	10 504 130	0,79	
SWITZERLAND 2.25000% 11-22.06.31*	CHF	4 200 000	500 000		4 700 000	6 002 840	0,45	
SWITZERLAND 2.50000% 06-08.03.36*	CHF	7 050 000	250 000		7 300 000	10 109 040	0,76	
SWITZERLAND 3.00000% 03-08.01.18*	CHF	450 000		450 000				
SWITZERLAND 3.00000% 04-12.05.19*	CHF	11 900 000	1 000 000		12 900 000	13 702 380	1,03	
SWITZERLAND 3.25000% 07-27.06.27*	CHF	4 050 000	950 000		5 000 000	6 597 500	0,49	
SWITZERLAND 3.50000% 03-08.04.33*	CHF	7 550 000	250 000		7 800 000	11 658 660	0,87	
SWITZERLAND 4.00000% 98-11.02.23*	CHF	9 550 000	250 000		9 800 000	12 161 800	0,91	
SWITZERLAND 4.00000% 98-08.04.28*	CHF	11 600 000	300 000		11 900 000	16 874 200	1,26	
SWITZERLAND 4.00000% 99-06.01.49*	CHF	4 850 000	250 000		5 100 000	10 353 000	0,78	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF	2 500 000	650 000		3 150 000	3 294 900	0,25	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 16-30.05.58*	CHF	2 200 000			2 200 000	2 238 500	0,17	
Total CHF						**170 026 820**	**12,74**	
EUR								
ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.12500% 17-12.01.32*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 667 647	0,12	
ACCOR SA-REG-S 1.25000% 17-25.01.24*	EUR	1 200 000		400 000	800 000	917 616	0,07	
ALLERGAN FUNDING SCS 1.25000% 17-01.06.24*	EUR		960 000	960 000				
AMERICAN TOWER CORP 1.37500% 17-04.04.25*	EUR		710 000	710 000				
ASAHI GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 1.15100% 17-19.09.25*	EUR		446 000		446 000	510 617	0,04	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S 2.50000% 14-16.01.24*	EUR	2 560 000			2 560 000	3 295 887	0,25	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 6.25000% 97-15.07.27*	EUR	550 000			550 000	973 964	0,07	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.90000% 04-15.07.20*	EUR	750 000			750 000	963 353	0,07	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A 4.15000% 07-15.03.37*	EUR	750 000			750 000	1 294 785	0,10	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A 4.35000% 07-15.03.19*	EUR	620 000			620 000	760 081	0,06	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A 4.85000% 09-15.03.26*	EUR	470 000			470 000	739 319	0,06	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.65000% 11-20.04.22*	EUR	470 000			470 000	633 572	0,05	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A 3.80000% 12-26.01.62*	EUR	190 000			190 000	355 510	0,03	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 13-20.10.23*	EUR	490 000	110 000		600 000	758 493	0,06	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 2.40000% 13-23.05.34*	EUR	370 000			370 000	506 121	0,04	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S-1.15000% 13-19.10.18*	EUR	360 000			360 000	419 088	0,03	
AUSTRIA, REPUBLIC OF 1.65000% 14-21.10.24*	EUR	540 000	110 000		650 000	819 269	0,06	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 14-18.10.19*	EUR	400 000			400 000	465 150	0,03	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.20000% 15-20.10.25*	EUR	620 000			620 000	756 648	0,06	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.75000% 16-20.10.26*	EUR	700 000			700 000	815 253	0,06	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.50000% 16-20.02.47*	EUR	150 000			150 000	168 259	0,01	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.50000% 16-02.11.86*	EUR	100 000			100 000	96 855	0,01	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.50000% 17-20.04.27*	EUR		200 000		200 000	226 112	0,02	
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL 4.00000% 06-24.03.21*	EUR	1 600 000			1 600 000	2 077 744	0,16	
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A. 4.25000% 06-14.06.18*	EUR	500 000			500 000	589 135	0,04	
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL 4.50000% 09-02.12.19*	EUR	2 600 000			2 600 000	3 271 604	0,25	
AYT CEDULAS CAJAS IX-B 4.00000% 05-31.03.20*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 518 050	0,19	
AYT CEDULAS CAJAS VFTA 4.75000% 03-04.12.18*	EUR	3 500 000			3 500 000	4 235 524	0,32	
BANCO DE SABADELL SA-REG-S 0.62500% 16-10.06.24*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 605 683	0,12	
BANCO DE SABADELL SA-REG-S 1.00000% 17-26.04.27*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 475 184	0,11	
BANCO POPULAR ESPANOL SA-REG-S 2.12500% 14-08.10.19*	EUR	2 800 000		2 800 000				
BANCO POPULAR ESPANOL SA-REG-S 1.00000% 15-07.04.25*	EUR	2 100 000		2 100 000				
BANK OF IRELAND MORTGAGE BANK-REG-S 1.87500% 13-13.05.17*	EUR	3 020 000		3 020 000				
BANK OF MONTREAL-REG-S 0.10000% 16-14.01.19*	EUR	1 800 000			1 800 000	2 069 886	0,16	
BANKIA SA 4.12500% 06-24.03.36*	EUR	600 000			600 000	870 929	0,07	
BANKIA SA 4.25000% 06-25.05.18*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 524 346	0,26	
BANKIA SA 4.50000% 07-26.04.22*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 363 182	0,10	
BANKIA SA-REG-S 1.00000% 15-25.09.25*	EUR	2 400 000			2 400 000	2 765 997	0,21	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
BERLIN HYP AG 0.12500% 17-23.10.23*	EUR		1 800 000		1 800 000	2 046 454	0,15	
BRENNTAG FINANCE BV-REG-S 1.12500% 17-27.09.25*	EUR		670 000		670 000	760 770	0,06	
BRIGHT FOOD SINGAPORE HOLDINGS-REG-S 1.12500% 17-18.07.20*	EUR		730 000		730 000	841 708	0,06	
BURGER KING FRANCE SAS-REG-S 6.00000% 17-01.05.24*	EUR		630 000		630 000	775 569	0,06	
CAISSE FRANCAISE DE FIN LOCAL-REG-S 1.75000% 13-16.07.20*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 414 194	0,18	
CAIXABANK SA-REG-S 0.62500% 15-12.11.20*	EUR	2 200 000			2 200 000	2 566 577	0,19	
CAIXABANK SA-REG-S 1.25000% 17-11.01.27*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 751 535	0,13	
CAJA RURAL DE CASTILLA-LA MANCHA-REG-S 0.87500% 16-27.05.24*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 271 586	0,10	
CEDULAS TDA 6 3.87500% 05-23.05.25*	EUR	2 700 000			2 700 000	3 778 435	0,28	
CK HUTCHISON FINANCE 16 II LTD-REG-S 0.87500% 16-03.10.24*	EUR	930 000		930 000				
CNRC CAPITAL LTD-REG-S 1.87100% 16-07.12.21*	EUR	1 170 000		1 170 000				
COENTREPRISE DE TRANS D'ELECTRIC-REG-S 2.12500% 17-29.07.32*	EUR		800 000	800 000				
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER-REG-S 0.12500% 15-18.06.18*	EUR	3 200 000			3 200 000	3 673 245	0,28	
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER-REG-S 0.22500% 16-14.09.26*	EUR	1 900 000			1 900 000	2 067 081	0,15	
DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 1.90000% 15-19.03.27*	EUR		800 000		800 000	890 272	0,07	
DOVER CORP 1.25000% 16-09.11.26*	EUR	920 000			920 000	1 039 030	0,08	
FEDERAL-MOGUL LLC & FED-ML FIN-REG-S 5.00000% 17-15.07.24*	EUR		1 610 000		1 610 000	1 820 016	0,14	
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-REG-S 0.37500% 14-22.10.19*	EUR	3 050 000			3 050 000	3 529 810	0,26	
FINLAND, REPUBLIC OF 4.37500% 08-04.07.19*	EUR	230 000			230 000	286 361	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF 4.00000% 09-04.07.25*	EUR	450 000		150 000	300 000	440 979	0,03	
FINLAND, REPUBLIC OF 2.75000% 12-04.07.28*	EUR	230 000			230 000	319 660	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF 2.62500% 12-04.07.42*	EUR	190 000			190 000	282 710	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.62500% 12-15.09.22*	EUR	240 000			240 000	298 834	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.12500% 13-15.09.18*	EUR	230 000			230 000	267 550	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.00000% 14-15.04.24*	EUR	230 000			230 000	295 110	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.37500% 14-15.09.20*	EUR	260 000			260 000	304 857	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.75000% 15-15.04.31*	EUR	160 000			160 000	179 154	0,01	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.87500% 15-15.09.25*	EUR	190 000			190 000	226 373	0,02	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.50000% 16-15.04.26*	EUR	250 000			250 000	287 501	0,02	
FRANCE, REPUBLIC OF 4.75000% 03-25.04.35*	EUR	920 000	180 000		1 100 000	1 935 283	0,15	
FRANCE, REPUBLIC OF 4.25000% 07-25.10.18*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 563 769	0,12	
FRANCE, REPUBLIC OF OAT-REG-S 2.50000% 10-25.10.20*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 621 943	0,12	
FRANCE, REPUBLIC OF OAT 2.25000% 12-25.10.22*	EUR	1 450 000			1 450 000	1 857 390	0,14	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.75000% 01-25.10.32*	EUR	1 150 000	150 000		1 300 000	2 426 349	0,18	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.25000% 03-25.04.19*	EUR	1 090 000	110 000		1 200 000	1 477 137	0,11	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 8.50000% 89-25.10.19*	EUR	310 000			310 000	421 316	0,03	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 8.50000% 92-25.04.23*	EUR	360 000			360 000	607 660	0,05	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 6.00000% 94-25.10.25*	EUR	1 150 000			1 150 000	1 903 975	0,14	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.50000% 98-25.04.29*	EUR	1 310 000			1 310 000	2 251 817	0,17	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 05-25.04.55*	EUR	600 000			600 000	1 071 338	0,08	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.75000% 05-25.04.21*	EUR	1 630 000			1 630 000	2 140 729	0,16	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 06-25.10.38*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 667 859	0,12	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.25000% 07-25.10.23*	EUR	1 620 000			1 620 000	2 326 731	0,17	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 08-25.04.18*	EUR	1 000 000		1 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.50000% 09-25.04.41*	EUR	1 050 000	200 000		1 250 000	2 253 048	0,17	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.75000% 09-25.10.19*	EUR	1 570 000		220 000	1 350 000	1 683 059	0,13	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.50000% 10-25.04.20*	EUR	1 250 000	300 000		1 550 000	1 954 830	0,15	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 10-25.04.60*	EUR	420 000	80 000		500 000	912 395	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.50000% 10-25.04.26*	EUR	1 250 000	350 000	250 000	1 350 000	1 931 314	0,14	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.25000% 11-25.10.21*	EUR	1 270 000	380 000		1 650 000	2 161 635	0,16	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.00000% 12-25.04.22*	EUR	1 800 000			1 800 000	2 363 233	0,18	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.75000% 12-25.10.27*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 907 205	0,14	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.00000% 12-25.05.18*	EUR	830 000		830 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 674 578	0,13	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 13-25.05.23*	EUR	1 340 000			1 340 000	1 685 077	0,13	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.00000% 13-25.11.18*	EUR	780 000			780 000	908 425	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.25000% 13-25.05.24*	EUR	1 250 000			1 250 000	1 627 479	0,12	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.00000% 14-25.05.19*	EUR	800 000			800 000	939 039	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.50000% 13-25.05.30*	EUR	1 090 000	360 000	350 000	1 100 000	1 474 032	0,11	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 14-25.11.24*	EUR	1 040 000	160 000		1 200 000	1 516 519	0,11	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.50000% 14-25.11.19*	EUR	930 000	280 000		1 210 000	1 415 438	0,11	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.50000% 15-25.05.25*	EUR	1 350 000			1 350 000	1 558 699	0,12	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.00000% 15-25.02.18*	EUR	730 000		730 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.00000% 15-25.11.25*	EUR	920 000			920 000	1 096 964	0,08	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.25000% 15-25.11.20*	EUR	1 250 000		450 000	800 000	934 161	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.50000% 15-25.05.31*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 554 281	0,12	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 15-25.02.19*	EUR	720 000			720 000	830 507	0,06	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 16-25.05.26*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 136 908	0,09	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 15-25.05.66*	EUR	180 000			180 000	190 759	0,01	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.25000% 15-25.05.36*	EUR	500 000	500 000	350 000	650 000	718 357	0,05	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.25000% 15-25.11.26*	EUR	450 000	750 000		1 200 000	1 322 134	0,10	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 16-25.05.22*	EUR		800 000		800 000	922 219	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 17-25.06.39*	EUR	350 000			350 000	415 169	0,03	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.00000% 17-25.05.27*	EUR		650 000		650 000	761 207	0,06	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 2.00000% 17-25.05.48*	EUR		300 000		300 000	355 914	0,03	
GENERAL ELECTRIC CO 1.50000% 17-17.05.29*	EUR		960 000		960 000	1 097 789	0,08	
GENERAL ELECTRIC CO 2.12500% 17-17.05.37*	EUR		1 010 000		1 010 000	1 145 700	0,09	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.50000% 13-15.02.23*	EUR	1 450 000	7 300 000	2 000 000	6 750 000	8 441 237	0,63	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.50000% 13-15.05.23*	EUR	1 590 000			1 590 000	1 992 309	0,15	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.00000% 13-15.08.23*	EUR	1 650 000		450 000	1 200 000	1 546 471	0,12	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.75000% 14-15.02.24*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 916 702	0,14	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.50000% 14-15.08.46*	EUR	1 400 000	430 000		1 830 000	2 726 187	0,20	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.50000% 14-15.05.24*	EUR	7 050 000			7 050 000	8 890 838	0,67	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.00000% 14-15.08.24*	EUR	1 940 000		790 000	1 150 000	1 406 710	0,11	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.50000% 15-15.02.25*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 652 414	0,12	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 15-15.08.25*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 832 265	0,14	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 16-15.02.26*	EUR	5 560 000		3 310 000	2 250 000	2 633 762	0,20	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 17-15.02.27*	EUR	2 770 000	1 550 000	1 190 000	3 130 000	3 535 355	0,26	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-15.06.18*	EUR	1 300 000		1 300 000				
GERMANY, REPUBLIC OF 6.25000% 94-04.01.24*	EUR	900 000	250 000	300 000	850 000	1 357 640	0,10	
GERMANY, REPUBLIC OF 6.50000% 97-04.07.27*	EUR	1 100 000		100 000	1 000 000	1 814 646	0,14	
GERMANY, REPUBLIC OF 5.62500% 98-04.01.28*	EUR	910 000	140 000		1 050 000	1 825 107	0,14	
GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 98-04.07.28*	EUR	900 000			900 000	1 485 900	0,11	
GERMANY, REPUBLIC OF 6.25000% 00-04.01.30*	EUR	700 000			700 000	1 333 897	0,10	
GERMANY, REPUBLIC OF 5.50000% 00-04.01.31*	EUR	1 300 000	1 400 000		2 700 000	4 974 175	0,37	
GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 03-04.07.34*	EUR	1 720 000		320 000	1 400 000	2 570 622	0,19	
GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37*	EUR	1 560 000	190 000		1 750 000	3 064 350	0,23	
GERMANY, REPUBLIC OF 4.25000% 07-04.07.39*	EUR	1 410 000		410 000	1 000 000	1 855 991	0,14	
GERMANY, REPUBLIC OF 4.25000% 08-04.07.18*	EUR	1 400 000		1 400 000				
GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 08-04.07.40*	EUR	1 350 000			1 350 000	2 693 963	0,20	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.75000% 08-04.01.19*	EUR	2 250 000			2 250 000	2 720 704	0,20	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19*	EUR	2 100 000			2 100 000	2 581 963	0,19	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 09-04.01.20*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 745 138	0,13	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.00000% 10-04.07.20*	EUR	1 700 000			1 700 000	2 141 557	0,16	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.25000% 10-04.09.20*	EUR	1 250 000			1 250 000	1 551 410	0,12	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.50000% 10-04.01.21*	EUR	1 600 000		350 000	1 250 000	1 574 531	0,12	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 10-04.07.42*	EUR	1 130 000		280 000	850 000	1 411 545	0,11	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 11-04.07.21*	EUR	1 460 000			1 460 000	1 908 027	0,14	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.25000% 11-04.09.21*	EUR	1 280 000			1 280 000	1 622 467	0,12	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.00000% 11-04.01.22*	EUR	3 580 000		350 000	3 230 000	4 078 490	0,31	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 12-04.07.22*	EUR	2 100 000			2 100 000	2 642 690	0,20	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.50000% 12-04.07.44*	EUR	1 830 000		250 000	1 580 000	2 335 575	0,17	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.50000% 12-04.09.22*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 495 709	0,11	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.50000% 13-23.02.18*	EUR	830 000		830 000				
GERMANY, REPUBLIC OF 0.25000% 13-13.04.18*	EUR	930 000		930 000				
GERMANY, REPUBLIC OF 1.00000% 13-12.10.18*	EUR	930 000			930 000	1 082 824	0,08	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.00000% 14-22.02.19*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 640 563	0,12	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.50000% 14-12.04.19*	EUR	880 000			880 000	1 025 745	0,08	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.25000% 14-11.10.19*	EUR	1 500 000		400 000	1 100 000	1 282 659	0,10	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.00000% 15-17.04.20*	EUR	1 750 000			1 750 000	2 035 029	0,15	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 15-16.10.20*	EUR	1 240 000			1 240 000	1 455 212	0,11	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-08.10.21*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 630 410	0,12	
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC-REG-S 1.00000% 17-12.09.26*	EUR		740 000	740 000				
GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.25000% 17-30.04.24*	EUR		1 010 000		1 010 000	1 185 987	0,09	
HAMBURGER SPARKASSE AG 0.37500% 17-23.05.24*	EUR		1 400 000		1 400 000	1 600 607	0,12	
HELLA FINANCE INTERNATIONAL BV 1.00000% 17-17.05.24*	EUR		340 000	340 000				
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.87500% 16-06.09.24*	EUR	710 000			710 000	807 261	0,06	
IM CEDULAS 7 4.00000% 06-31.03.21*	EUR	2 200 000			2 200 000	2 855 787	0,21	
KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES-REG-S 2.37500% 15-10.09.25*	EUR	563 000		563 000				
KUTXABANK SA-REG-S 1.25000% 15-22.09.25*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 539 685	0,27	
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 0.25000% 15-21.07.20*	EUR	3 990 000			3 990 000	4 627 772	0,35	
LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN GZ-REG-S 0.20000% 15-22.04.22*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 736 585	0,43	
LONDON STOCK EX GROUP PLC-REG-S 1.75000% 17-19.09.29*	EUR		300 000	300 000				
LOXAM SAS-REG-S 4.25000% 17-15.04.24*	EUR		590 000		590 000	722 493	0,05	
LUXEMBOURG GOVERNMENT BOND-REG-S 2.12500% 13-10.07.23*	EUR	140 000			140 000	179 485	0,01	
LUXEMBOURG GOVERNMENT BOND-REG-S 0.62500% 17-01.02.27*	EUR		200 000		200 000	228 839	0,02	
LUXEMBOURG, GRAND DUCHY OF 3.37500% 10-18.05.20*	EUR	100 000			100 000	125 858	0,01	
LUXEMBOURG, GRAND DUCHY OF 2.25000% 12-21.03.22*	EUR	100 000			100 000	126 823	0,01	
MAGNA INTERNATIONAL INC 1.90000% 15-24.11.23*	EUR	420 000			420 000	515 432	0,04	
MAGNA INTERNATIONAL INC 1.50000% 17-25.09.27*	EUR		580 000		580 000	673 790	0,05	
MCKESSON CORP 0.62500% 17-17.08.21*	EUR	590 000		590 000				
NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 0.50000% 15-26.01.22*	EUR	2 108 000			2 108 000	2 450 928	0,18	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 7.50000% 93-15.01.23*	EUR	400 000	200 000		600 000	965 932	0,07	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 05-15.01.37*	EUR	870 000	130 000	150 000	850 000	1 480 596	0,11	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 3.75000% 06-15.01.23*	EUR	240 000			240 000	331 781	0,02	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 5.50000% 98-15.01.28*	EUR	850 000			850 000	1 455 337	0,11	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 08-15.07.18*	EUR	830 000		830 000				
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 09-15.07.19*	EUR	850 000			850 000	1 054 210	0,08	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 3.50000% 10-15.07.20*	EUR	900 000			900 000	1 147 550	0,09	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 3.75000% 10-15.01.42*	EUR	890 000	110 000		1 000 000	1 766 211	0,13	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 3.25000% 11-15.07.21*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 304 717	0,10	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.25000% 12-15.07.22*	EUR	950 000			950 000	1 217 617	0,09	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.50000% 12-15.01.33*	EUR	740 000	110 000		850 000	1 195 293	0,09	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 1.75000% 13-15.07.23*	EUR	1 140 000			1 140 000	1 441 619	0,11	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 1.25000% 13-15.01.19*	EUR	830 000			830 000	973 085	0,07	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.75000% 14-15.01.47*	EUR	700 000			700 000	1 082 095	0,08	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.00000% 14-15.07.24*	EUR	860 000			860 000	1 110 006	0,08	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 0.25000% 14-15.01.20*	EUR	850 000	150 000		1 000 000	1 166 809	0,09	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 0.00000% 15-15.04.18*	EUR	880 000		880 000				
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 0.25000% 15-15.07.25*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 142 410	0,09	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.50000% 16-15.07.26*	EUR	600 000	350 000		950 000	1 094 037	0,08	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.75000% 17-15.07.27*	EUR	350 000	200 000		550 000	639 405	0,05	
OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 16-15.11.24*	EUR		1 190 000		1 190 000	1 403 218	0,11	
OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 17-15.11.24*	EUR	1 190 000		1 190 000				
PARKER-HANNIFIN CORP-144A 1.12500% 17-01.03.25*	EUR	580 000		580 000				
PRICELINE GROUP INC 0.80000% 17-10.03.22*	EUR	930 000		930 000				
QUINTILES IMS INC-REG-S 3.25000% 17-15.03.25*	EUR	1 000 000		1 000 000				
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.87500% 17-24.01.22*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 388 476	0,10	
SANTANDER UK GROUP HOLD PLC-REG-S 1.12500% 16-08.09.23*	EUR	500 000		500 000				
SIGMA ALIMENTOS-REG-S 2.62500% 17-07.02.24*	EUR	700 000			700 000	847 770	0,06	
SWEDBANK HYPOTEK AB 1.12500% 13-07.05.20*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 550 735	0,27	
SWEDBANK HYPOTEK AB-REG-S 0.37500% 15-11.03.22*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 623 748	0,12	
TELEPERFORMANCE-REG-S 1.50000% 17-03.04.24*	EUR		600 000	600 000				
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.95000% 17-24.07.29*	EUR		670 000	670 000				
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.87500% 17-24.07.37*	EUR		710 000	710 000				
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 0.25000% 15-27.04.22*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 445 623	0,26	
Total EUR						**295 365 994**	**22,13**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GBP								
DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 2.50000% 17-20.09.24*	GBP		647 000		647 000	820 781	0,06	
DRAX FINCO PLC-REG-S 4.25000% 17-01.05.22*	GBP		550 000	550 000				
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 1.70000% 17-30.06.22*	GBP		470 000		470 000	606 582	0,05	
SAGA PLC-REG-S 3.37500% 17-12.05.24*	GBP		560 000	560 000				
THAMES WATER UTILITIES CAYMAN FIN-REG-S 4.00000% 14-19.06.25*	GBP	250 000			250 000	365 045	0,03	
Total GBP						**1 792 408**	**0,13**	
USD								
BP CAPITAL MARKETS PLC 3.11900% 16-04.05.26*	USD	650 000			650 000	628 717	0,05	
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 5.15000% 13-01.09.43*	USD	1 500 000			1 500 000	1 727 069	0,13	
COMCAST CORP 3.37500% 14-15.02.25*	USD	1 100 000		1 100 000				
CONSOLIDATED EDISON INC 2.00000% 16-15.05.21*	USD	1 000 000			1 000 000	958 154	0,07	
ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.20000% 17-15.04.27*	USD	290 000			290 000	284 112	0,02	
JSW STEEL LTD-REG-S 5.25000% 17-13.04.22*	USD		1 640 000	1 640 000				
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.00000% 16-15.02.27*	USD	1 230 000			1 230 000	1 171 710	0,09	
STARBUCKS CORP 2.45000% 16-15.06.26*	USD	390 000			390 000	362 791	0,03	
SYNCHRONY FINANCIAL 3.00000% 14-15.08.19*	USD	600 000			600 000	590 050	0,04	
TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 6.50000% 06-27.10.36*	USD	450 000			450 000	550 806	0,04	
TELSTRA CORP LTD-REG-S 3.12500% 15-07.04.25*	USD	800 000			800 000	775 675	0,06	
TIME WARNER INC 5.35000% 13-15.12.43*	USD	1 000 000			1 000 000	1 042 328	0,08	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.50000% 17-16.03.47*	USD	1 010 000		1 010 000				
Total USD						**8 091 411**	**0,61**	
Total Anleihen, fester Zins						**475 276 633**	**35,61**	
Anleihen, Nullcoupon								
CHF								
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 16-22.06.29*	CHF	3 000 000	700 000		3 700 000	3 664 850	0,27	
Total CHF						**3 664 850**	**0,27**	
EUR								
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 16-15.07.23*	EUR	300 000		150 000	150 000	171 452	0,01	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 16-15.09.23*	EUR	300 000			300 000	342 249	0,03	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 17-15.04.22*	EUR		250 000		250 000	288 851	0,02	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 15-25.05.20*	EUR	800 000			800 000	926 447	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 16-25.05.21*	EUR	800 000			800 000	926 520	0,07	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 17-25.02.20*	EUR		900 000		900 000	1 041 542	0,08	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-15.08.26*	EUR	2 350 000			2 350 000	2 616 518	0,20	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-16.03.18*	EUR	800 000		800 000				
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-14.09.18*	EUR	1 800 000		1 030 000	770 000	886 834	0,07	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-14.12.18*	EUR	650 000			650 000	750 069	0,06	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 17-14.06.19*	EUR		400 000		400 000	463 310	0,03	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-09.04.21*	EUR	1 750 000			1 750 000	2 039 053	0,15	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 17-08.04.22*	EUR		1 750 000	500 000	1 250 000	1 453 349	0,11	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.00000% 16-15.01.22*	EUR	600 000	200 000		800 000	927 517	0,07	
Total EUR						**12 833 711**	**0,96**	
Total Anleihen, Nullcoupon						**16 498 561**	**1,24**	
Anleihen, variabler Zins								
EUR								
ALLIANZ SE-REG-S-SUB 2.241%/VAR 15-07.07.45*	EUR	900 000			900 000	1 053 855	0,08	
BERTELSMANN SE & CO KGAA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 15-23.04.75*	EUR		300 000	300 000				
EVONIK INDUSTRIES AG-REG-S-SUB 2.125%/VAR 17-07.07.77*	EUR		530 000		530 000	619 512	0,05	
MERCK KGAA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 14-12.12.74*	EUR	650 000		650 000				
TELIA CO AB-REG-S-SUB 3.000%/VAR 17-04.04.78*	EUR		860 000		860 000	1 020 858	0,08	
TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.993%/VAR 17-PRP*	EUR		1 090 000		1 090 000	1 281 672	0,10	
Total EUR						**3 975 897**	**0,30**	
GBP								
AVIVA PLC-REG-S-SUB 4.375%/FLR 16-12.09.49*	GBP		900 000		900 000	1 196 415	0,09	
CENTRICA PLC-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-10.04.75*	GBP	800 000			800 000	1 111 149	0,08	
Total GBP						**2 307 564**	**0,17**	
USD								
CNRC CAPITALE LTD-REG-S 3.900%/VAR 17-PRP*	USD		400 000		400 000	390 910	0,03	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30*	USD	1 000 000			1 000 000	1 421 073	0,11	
SSE PLC-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-16.09.77*	USD	810 000			810 000	811 940	0,06	
Total USD						**2 623 924**	**0,20**	
Total Anleihen, variabler Zins						**8 907 385**	**0,67**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**1 016 675 059**	**76,17**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden								
Notes, fester Zins								
USD								
ABBOTT LABORATORIES 2.90000% 16-30.11.21*	USD	1 290 000			1 290 000	1 271 089	0,10	
AMAZON.COM INC-144A 2.80000% 17-22.08.24*	USD		680 000		680 000	660 495	0,05	
AMAZON.COM INC-144A 4.05000% 17-22.08.47*	USD		970 000		970 000	956 518	0,07	
APPALACHIAN POWER CO 4.40000% 14-15.05.44*	USD	1 100 000			1 100 000	1 138 876	0,09	
AT&T INC 4.90000% 17-14.08.37*	USD		950 000	950 000				
BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 4.50000% 15-01.02.45*	USD	1 350 000			1 350 000	1 412 496	0,11	
CDK GLOBAL INC-144A 4.87500% 17-01.06.27*	USD		115 000	115 000				
COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.50000% 17-15.08.27*	USD		1 810 000		1 810 000	1 723 620	0,13	
DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-144A 5.75000% 17-15.04.25*	USD		1 010 000		1 010 000	1 030 415	0,08	
DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 4.42000% 16-15.06.21*	USD	1 080 000			1 080 000	1 097 170	0,08	
DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 6.35000% 10-01.06.40*	USD	700 000		700 000				
DOMINION ENERGY INC-SUB STEP-UP/DOWN 16-01.07.19*	USD	280 000		280 000				
ENBRIDGE INC 3.70000% 17-15.07.27*	USD		540 000		540 000	528 580	0,04	
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.85000% 13-15.03.44*	USD	1 000 000			1 000 000	1 038 893	0,08	
FIFTH THIRD BANK-SUB 3.85000% 16-15.03.26*	USD	1 800 000			1 800 000	1 789 303	0,13	
GENERAL MOTORS CO 4.20000% 17-01.10.27*	USD		1 560 000		1 560 000	1 531 455	0,11	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.25000% 11-01.02.41*	USD	650 000			650 000	830 256	0,06	
HALLIBURTON CO 4.75000% 13-01.08.43*	USD	1 000 000			1 000 000	1 021 467	0,08	
INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.12500% 17-14.07.22*	USD		520 000		520 000	504 394	0,04	
KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.15000% 13-01.02.24*	USD	1 500 000			1 500 000	1 504 468	0,11	
KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46*	USD	990 000			990 000	945 886	0,07	
KRAFT HEINZ FOODS CO 2.80000% 16-02.07.20*	USD	950 000			950 000	935 827	0,07	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.75000% 17-11.01.27*	USD	980 000			980 000	964 784	0,07	
MANUFACTURERS & TRADERS TRUST CO 2.10000% 15-06.02.20*	USD	860 000		860 000				
MCCORMICK & CO 3.15000% 17-15.08.24*	USD		670 000		670 000	654 044	0,05	
MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 2.00000% 16-28.10.21*	USD	790 000			790 000	750 576	0,06	
ONEOK INC 4.00000% 17-13.07.27*	USD		520 000		520 000	509 391	0,04	
ORACLE CORP 3.40000% 14-08.07.24*	USD	1 300 000			1 300 000	1 310 007	0,10	
PARKER-HANNIFIN CORP-144A 3.25000% 17-01.03.27*	USD	990 000			990 000	964 964	0,07	
PHILLIPS 66 4.87500% 14-15.11.44*	USD	1 100 000			1 100 000	1 154 836	0,09	
PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.62500% 17-17.02.22*	USD	2 100 000		1 000 000	1 100 000	1 076 147	0,08	
POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 17-01.03.25*	USD	400 000		400 000				
QUEST DIAGNOSTICS INC 4.25000% 14-01.04.24*	USD	400 000			400 000	413 297	0,03	
RECKITT BENCKISER TREAS SERV-REG-S 2.75000% 17-26.06.24*	USD		640 000		640 000	614 792	0,05	
SEAGATE HDD CAYMAN-144A 4.25000% 17-01.03.22*	USD	850 000			850 000	817 858	0,06	
SES GLOBAL AMERICAS HOLDINGS-REG-S 2.50000% 14-25.03.19*	USD	400 000		400 000				
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 6.12500% 06-17.08.26*	USD	400 000		400 000				
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.37500% 14-01.10.24*	USD	1 600 000			1 600 000	1 583 662	0,12	
SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 17-01.08.22*	USD		625 000		625 000	618 478	0,05	
SMITHFIELD FOODS INC-144A 3.35000% 17-01.02.22*	USD	1 120 000		1 120 000				
TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.62500% 14-01.03.34*	USD	750 000			750 000	793 781	0,06	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.45000% 14-15.03.21*	USD	1 300 000			1 300 000	1 307 706	0,10	
WILLIAMS PARTNERS LP 3.75000% 17-15.06.27*	USD		870 000	870 000				
Total USD						**33 455 526**	**2,51**	
Total Notes, fester Zins						**33 455 526**	**2,51**	
Notes, variabler Zins								
USD								
CITIGROUP INC 3.668%/VAR 17-24.07.28*	USD		1 870 000	870 000	1 000 000	977 077	0,07	
JP MORGAN CHASE & CO 4.032%/VAR 17-24.07.48*	USD		1 900 000		1 900 000	1 867 386	0,14	
NATIONAL RURAL UTILITIES CO FIN-SUB 4.75000%/VAR 13-30.04.43*	USD	500 000			500 000	502 265	0,04	
ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC 3.498%/VAR 17-15.05.23*	USD		1 000 000		1 000 000	973 540	0,07	
Total USD						**4 320 268**	**0,32**	
Total Notes, variabler Zins						**4 320 268**	**0,32**	
Medium-Term Notes, fester Zins								
EUR								
BANCO DE SABADELL SA 3.37500% 13-23.01.18*	EUR	3 600 000		3 600 000				
BRUSSELS AIRPORT CO NV/SA-REG-S 1.00000% 17-03.05.24*	EUR		600 000	600 000				
Total EUR							**0,00**	
USD								
BPCE SA-144A-SUB 4.87500% 16-01.04.26*	USD		1 000 000		1 000 000	1 027 540	0,08	
RYDER SYSTEM INC 2.80000% 17-01.03.22*	USD	710 000			710 000	693 323	0,05	
Total USD						**1 720 862**	**0,13**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**1 720 862**	**0,13**	
Anleihen, fester Zins								
EUR								
NORICAN GROUP APS-REG-S 4.50000% 17-15.05.23*	EUR		380 000	380 000				
Total EUR							**0,00**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
USD								
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.45000% 17-14.01.22*	USD	1 700 000		1 700 000				
GILEAD SCIENCES INC 3.70000% 14-01.04.24*	USD	500 000			500 000	510 958	0,04	
PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 4.50000% 16-15.12.26*	USD	1 320 000		1 320 000				
SOUTH CALIFORNIA GAS CO 3.15000% 14-15.09.24*	USD	800 000			800 000	790 663	0,06	
Total USD						**1 301 621**	**0,10**	
Total Anleihen, fester Zins						**1 301 621**	**0,10**	
Anleihen, variabler Zins								
USD								
ENTERPRISE PRODUCT OPERATING LP-SUB 4.875%/VAR 17-16.08.77*	USD		2 010 000		2 010 000	1 954 600	0,15	
STANLEY BLACK&DECKER-SUB 5.750%/3M LIBOR+430.4BP 13-15.12.53*	USD	900 000			900 000	905 674	0,07	
Total USD						**2 860 274**	**0,21**	
Total Anleihen, variabler Zins						**2 860 274**	**0,21**	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**43 658 551**	**3,27**	

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

Inhaberaktien								
Kanada								
TELUS CORPORATION COM NPV**	CAD	6 489			6 489	225 215	0,02	
Total Kanada						**225 215**	**0,02**	
Hongkong								
CHEUNG KONG INFSTR HKD1**	HKD	6 000	128 150	134 150				
Total Hongkong							**0,00**	
Vereinigte Staaten								
DOW CHEMICAL CO COM USD2.50**	USD	9 418	10 548	19 966				
Total Vereinigte Staaten							**0,00**	
Total Inhaberaktien						**225 215**	**0,02**	
Namensaktien								
Deutschland								
DEUTSCHE BOERSE AG NPV (ASD UK HLDCO123 PLC)**	EUR	5 065		5 065				
Total Deutschland							**0,00**	
Total Namensaktien							**0,00**	
Investmentzertifikate, open end								
Global								
DB ADVISORS EMERGING MARKETS EQUITIES - PASSIVE-ID-EUR-DIST**	EUR	462 012		24 000	438 012	67 991 195	5,10	
Total Global						**67 991 195**	**5,10**	
Total Investmentzertifikate, open end						**67 991 195**	**5,10**	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**68 216 410**	**5,12**	
Total Wertschriften						**1 128 550 020**	**84,56**	
(davon ausgeliehen							0,00)	
Bankguthaben auf Sicht						196 260 938	14,70	
Derivative Finanzinstrumente						1 210 917	0,09	
Sonstige Vermögenswerte						8 640 164	0,65	
Gesamtfondsvermögen						**1 334 662 039**	**100,00**	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-64 942 818		
Andere Verbindlichkeiten						-3 233 251		
Nettofondsvermögen						**1 266 485 970**		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamt-fondsvermögens[3]	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 064 673 818	79,76	1 008 385 319	69,06
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	65 087 118	4,89	61 890 060	4,24
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**1 129 760 936**	**84,65**	**1 070 275 379**	**73,30**

[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 Indices/Commodities/Währungen					
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17*	-1	GBP	95 150	-1 194	0.00
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17*	-30	EUR	859 021	-18 874	0.00
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17*	-67	USD	3 530 922	39 874	0.00
			4 485 093	19 806	0.00
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-OAT FUTURE 07.12.17*	-222	EUR	39 397 038	167 604	0.01
SWISS 10 YEARS FEDERAL BOND FUTURE 07.12.17*	-721	CHF	115 749 340	971 500	0.07
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.17*	-441	EUR	56 564 926	35 312	0.00
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.17*	-45	USD	7 189 873	209 546	0.02
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.17*	-90	USD	11 697 830	229 956	0.02
US LONG BOND FUTURE 19.12.17*	-30	USD	4 435 841	116 339	0.01
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17*	-90	USD	21 825 428	132 440	0.01
LONG GILT FUTURE 27.12.17*	-39	GBP	5 467 833	189 353	0.01
EURO-BONO FUTURE 07.12.17*	-123	EUR	19 377 107	39 304	0.00
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17*	-13	USD	2 713 286	8 648	0.00
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17*	-64	USD	7 276 352	73 053	0.01
EURO-BUND FUTURE 07.12.17*	-292	EUR	107 560 426	278 322	0.02
EURO-BOBL FUTURE 07.12.17*	-697	EUR	104 589 291	295 000	0.02
EURO BUXL FUTURE 07.12.17*	-108	EUR	20 169 278	247 081	0.02
			524 013 849	2 993 458	0.22

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17*	2	JPY	287 963	2 321	0.00
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17*	6	USD	730 374	7 794	0.00
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17*	51	EUR	2 577 062	55 422	0.00
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17*	1 000	CHF	91 310 000	1 281 010	0.10
			94 905 399	1 346 547	0.10
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
LONG GILT FUTURE 27.12.17*	5	GBP	-5 467 833	-19 603	0.00
			-5 467 833	-19 603	0.00

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 89 437 566

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
CAD	4 800 000	CHF	3 675 600	03.10.2017	-38 053	0.00
AUD	1 700 000	CHF	1 292 170	03.10.2017	1 484	0.00
SGD	1 200 000	CHF	847 158	03.10.2017	-7 895	0.00
EUR	8 800 000	CHF	10 063 460	03.10.2017	-2 831	0.00
GBP	4 600 000	CHF	5 689 050	03.10.2017	-282 580	-0.02
HKD	11 900 000	CHF	1 459 406	03.10.2017	-14 782	0.00
JPY	236 400 000	CHF	2 065 350	03.10.2017	33 274	0.00
USD	32 600 000	CHF	31 250 360	03.10.2017	-293 400	-0.02
SEK	3 500 000	CHF	422 552	03.10.2017	7 647	0.00
USD	1 650 000	CHF	1 579 875	03.10.2017	-16 665	0.00
EUR	1 200 000	CHF	1 368 900	03.10.2017	-3 776	0.00
GBP	400 000	CHF	497 800	03.10.2017	-21 472	0.00
CAD	250 000	CHF	193 375	03.10.2017	-44	0.00
USD	700 000	CHF	667 996	03.10.2017	-9 324	0.00
EUR	170 830 000	CHF	195 583 267	04.10.2017	178 922	0.01

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
EUR	1 756 543	CHF	2 000 000	04.10.2017	-9 226	0.00
CHF	197 580 000	EUR	172 393 334	04.10.2017	-387 431	-0.03
EUR	74 250 000	CHF	82 391 513	20.10.2017	-2 520 386	-0.19
EUR	400 000	CHF	443 860	20.10.2017	-13 578	0.00
EUR	57 500 000	CHF	65 396 475	27.10.2017	-354 518	-0.03
JPY	1 108 000 000	CHF	9 678 631	27.10.2017	158 763	0.01
EUR	9 220 000	CHF	10 508 956	27.10.2017	-34 073	0.00
AUD	1 500 000	CHF	1 134 150	27.10.2017	-2 300	0.00
CAD	4 600 000	CHF	3 518 080	27.10.2017	-35 196	0.00
GBP	3 830 000	CHF	4 720 877	27.10.2017	-246 681	-0.02
USD	34 980 000	CHF	33 304 458	27.10.2017	-482 043	-0.04
HKD	15 570 000	CHF	1 897 392	27.10.2017	-29 445	0.00
EUR	1 300 000	CHF	1 489 670	27.10.2017	3 126	0.00
GBP	9 747 205	CHF	12 731 312	31.10.2017	89 918	0.01
USD	157 882 053	CHF	152 728 783	31.10.2017	254 150	0.02
EUR	58 269 980	CHF	66 738 065	31.10.2017	108 252	0.01
CHF	2 887 411	EUR	2 521 096	31.10.2017	-4 621	0.00
JPY	260 000 000	CHF	2 232 526	02.11.2017	-1 152	0.00
AUD	1 800 000	CHF	1 363 860	02.11.2017	789	0.00
SEK	3 800 000	CHF	450 424	02.11.2017	116	0.00
USD	34 900 000	CHF	33 688 970	02.11.2017	-6 284	0.00
GBP	4 900 000	CHF	6 353 095	02.11.2017	-880	0.00
EUR	10 400 000	CHF	11 889 800	02.11.2017	-1 658	0.00
SGD	1 250 000	CHF	889 110	02.11.2017	56	0.00
CAD	5 300 000	CHF	4 090 540	02.11.2017	-1 919	0.00
HKD	12 000 000	CHF	1 485 608	02.11.2017	937	0.00
EUR	170 200 000	CHF	194 977 716	03.11.2017	371 940	0.03
EUR	66 000 000	CHF	75 161 460	17.11.2017	-288 970	-0.02
EUR	85 700 000	CHF	98 708 403	15.12.2017	772 518	0.05
					-3 129 291	-0.23

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 Indices/Commodities/Währungen			
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.17	EUR	66	66
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.17	USD	27	0
TOPIX INDEX FUTURE 07.09.17	JPY	29	29
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.09.17	GBP	34	34
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.09.17	USD	407	407
S&P500 EMINI FUTURE 15.09.17	USD	181	181
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.17	EUR	655	655
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17	JPY	5	5
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17	GBP	7	8
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17	USD	34	34
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17	EUR	141	171
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17	USD	80	147
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
SWISS 10 YEARS FEDERAL BOND FUTURE 07.09.17	CHF	721	721
EURO-BUXL FUTURE 07.09.17	EUR	135	135
EURO-OAT FUTURE 08.06.17	EUR	208	208
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.17	USD	126	0
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.17	USD	30	30
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.17	USD	50	50
SWISS 10 YEARS FEDERAL BOND FUTURE 08.06.17	CHF	480	480
EURO-BONO FUTURE 08.06.17	EUR	83	83
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.17	USD	89	89
LONG GILT FUTURE 28.06.17	GBP	28	28
US LONG BOND FUTURE 21.06.17	USD	46	6
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.17	USD	126	126
EURO-BUND FUTURE 08.06.17	EUR	274	253
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.17	EUR	301	301
EURO-BOBL FUTURE 08.06.17	EUR	480	480
EURO-BUXL FUTURE 08.06.17	EUR	73	73
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.17	USD	255	255
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.17	USD	30	30
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.09.17	USD	71	71
EURO-BONO FUTURE 07.09.17	EUR	128	128
EURO-OAT FUTURE 07.09.17	EUR	222	222
EURO-BUND FUTURE 07.09.17	EUR	423	423
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.09.17	USD	135	135
EURO-SCHATZ FUTURE 07.09.17	EUR	574	574
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.17	USD	128	128
US LONG BOND FUTURE 20.09.17	USD	50	50
EURO-BOBL FUTURE 07.09.17	EUR	891	891
LONG GILT FUTURE 27.09.17	GBP	39	39
EURO-OAT FUTURE 07.12.17	EUR	0	222
SWISS 10 YEARS FEDERAL BOND FUTURE 07.12.17	CHF	0	721

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.17	EUR	0	441
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.17	USD	0	45
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.17	USD	0	90
US LONG BOND FUTURE 19.12.17	USD	0	30
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17	USD	90	180
LONG GILT FUTURE 27.12.17	GBP	0	39
EURO-BONO FUTURE 07.12.17	EUR	0	123
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17	USD	0	13
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.17	USD	0	64
EURO-BUND FUTURE 07.12.17	EUR	0	292
EURO-BOBL FUTURE 07.12.17	EUR	0	697
EURO BUXL FUTURE 07.12.17	EUR	0	108

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
S&P500 EMINI FUTURE 16.06.17	USD	0	39
FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.17	GBP	0	2
TOPIX INDEX FUTURE 08.06.17	JPY	0	4
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.17	EUR	9	89
SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.17	CHF	0	1 014
TOPIX INDEX FUTURE 07.09.17	JPY	6	6
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.09.17	GBP	7	7
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.17	CHF	1 242	1 242
S&P500 EMINI FUTURE 15.09.17	USD	53	53
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.17	EUR	94	94
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17	JPY	2	0
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17	GBP	1	1
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17	USD	11	5
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17	EUR	73	22
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17	CHF	1 015	15
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
LONG GILT FUTURE 28.06.17	GBP	0	5
LONG GILT FUTURE 27.09.17	GBP	5	5
LONG GILT FUTURE 27.12.17	GBP	5	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	33 673 920	USD	33 600 000	07.04.2017
CHF	64 104 000	EUR	60 000 000	07.04.2017
CHF	8 331 960	EUR	7 800 000	07.04.2017
CHF	10 356 398	JPY	1 142 000 000	07.04.2017
CHF	1 470 326	AUD	1 940 000	07.04.2017
CHF	2 177 736	CAD	2 920 000	07.04.2017
CHF	4 211 818	GBP	3 380 000	07.04.2017
EUR	5 690 070	CHF	6 083 965	28.04.2017
CHF	153 125 472	USD	153 972 320	28.04.2017
CHF	12 028 851	GBP	9 438 835	28.04.2017
CHF	53 275 893	EUR	49 179 261	28.04.2017
CHF	100 040	USD	100 000	02.05.2017
CHF	37 460	CAD	50 000	02.05.2017
EUR	1 000 000	CHF	1 067 950	05.05.2017
CHF	184 356	JPY	21 000 000	18.05.2017
USD	602 225	CHF	585 302	30.05.2017
CHF	589 156	EUR	540 659	30.05.2017
GBP	9 438 835	CHF	12 015 637	31.05.2017
USD	153 972 320	CHF	152 822 147	31.05.2017
EUR	49 179 261	CHF	53 252 042	31.05.2017
EUR	1 543 512	CHF	1 672 472	31.05.2017
GBP	868 046	CHF	1 131 324	31.05.2017
GBP	932 439	CHF	1 178 789	31.05.2017
CHF	55 252 317	EUR	50 722 773	31.05.2017
EUR	174 200 000	CHF	188 554 080	02.06.2017
GBP	5 204 020	CHF	6 690 288	02.06.2017
EUR	9 795 183	CHF	10 610 142	02.06.2017
USD	30 665 881	CHF	30 461 186	02.06.2017
JPY	244 390 528	CHF	2 179 140	02.06.2017
SEK	5 473 098	CHF	614 817	02.06.2017
SGD	1 216 915	CHF	864 778	02.06.2017
HKD	12 964 850	CHF	1 656 215	02.06.2017
AUD	1 898 447	CHF	1 410 356	02.06.2017
CAD	4 669 003	CHF	3 395 299	02.06.2017
EUR	1 742 377	CHF	1 890 000	02.06.2017
JPY	1 148 000 000	CHF	10 392 056	23.06.2017
USD	33 640 000	CHF	33 555 059	23.06.2017
EUR	60 500 000	CHF	64 572 860	23.06.2017

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	8 500 000	CHF	9 070 520	23.06.2017
CAD	2 910 000	CHF	2 162 130	23.06.2017
AUD	1 980 000	CHF	1 491 336	23.06.2017
GBP	3 380 000	CHF	4 200 326	23.06.2017
EUR	980 000	CHF	1 047 346	23.06.2017
EUR	1 000 000	CHF	1 079 300	23.06.2017
EUR	1 000 000	CHF	1 082 450	23.06.2017
EUR	700 000	CHF	758 940	23.06.2017
CHF	176 112	AUD	240 000	23.06.2017
HKD	15 400 000	CHF	1 983 131	23.06.2017
EUR	450 000	CHF	492 615	23.06.2017
CHF	258 615	AUD	350 000	23.06.2017
JPY	87 000 000	CHF	763 694	23.06.2017
USD	220 000	CHF	218 966	23.06.2017
USD	1 200 000	CHF	1 158 660	23.06.2017
CHF	68 807 100	EUR	63 300 000	23.06.2017
CHF	816 148	HKD	6 530 000	23.06.2017
CHF	1 025 593	AUD	1 385 000	23.06.2017
CHF	2 122 416	CAD	2 890 000	23.06.2017
CHF	9 611 100	EUR	8 850 000	23.06.2017
CHF	33 971 070	USD	34 860 000	23.06.2017
CHF	10 730 685	JPY	1 229 200 000	23.06.2017
CHF	4 121 170	GBP	3 350 000	23.06.2017
EUR	85 700 000	CHF	91 501 890	30.06.2017
EUR	50 722 773	CHF	55 227 970	30.06.2017
USD	153 972 320	CHF	149 206 877	30.06.2017
GBP	11 239 320	CHF	14 025 547	30.06.2017
EUR	1 831 441	CHF	1 992 425	30.06.2017
USD	5 064 209	CHF	4 925 956	30.06.2017
EUR	1 970 643	CHF	2 143 370	30.06.2017
CHF	1 082 664	GBP	876 013	30.06.2017
CHF	1 581 083	GBP	1 279 038	30.06.2017
EUR	3 195 386	CHF	3 467 313	30.06.2017
CHF	11 199 087	GBP	9 084 269	30.06.2017
CHF	153 788 324	USD	159 036 529	30.06.2017
CHF	62 793 852	EUR	57 720 243	30.06.2017
CHF	300 172	JPY	35 000 000	03.07.2017
SGD	1 275 215	CHF	889 644	04.07.2017
GBP	5 200 000	CHF	6 486 480	04.07.2017
SEK	3 700 000	CHF	412 537	04.07.2017
EUR	8 900 000	CHF	9 680 530	04.07.2017
AUD	1 700 000	CHF	1 221 620	04.07.2017
HKD	11 500 000	CHF	1 425 119	04.07.2017
CAD	4 500 000	CHF	3 220 650	04.07.2017
JPY	227 000 000	CHF	1 984 092	04.07.2017
JPY	20 000 000	CHF	174 277	04.07.2017
EUR	1 000 000	CHF	1 088 000	04.07.2017
CHF	374 490	GBP	300 000	04.07.2017
CAD	200 000	CHF	143 580	04.07.2017
EUR	174 700 000	CHF	190 318 180	05.07.2017
USD	30 600 000	CHF	29 539 098	05.07.2017
USD	1 900 000	CHF	1 840 150	05.07.2017
EUR	1 914 560	CHF	2 075 000	05.07.2017
CHF	192 400 000	EUR	175 997 073	05.07.2017
JPY	73 000 000	CHF	621 435	21.07.2017
EUR	74 250 000	CHF	80 338 500	28.07.2017
USD	157 256 384	CHF	151 720 959	31.07.2017
GBP	9 087 065	CHF	11 190 493	31.07.2017
EUR	58 165 997	CHF	63 248 251	31.07.2017
GBP	335 660	CHF	418 971	31.07.2017
CHF	150 085 493	USD	157 256 384	31.07.2017
CHF	11 707 736	GBP	9 422 725	31.07.2017
CHF	64 535 174	EUR	58 165 997	31.07.2017
USD	32 622 271	CHF	31 183 629	02.08.2017
JPY	253 858 639	CHF	2 162 155	02.08.2017
AUD	1 918 513	CHF	1 405 886	02.08.2017
GBP	4 787 684	CHF	5 949 894	02.08.2017
EUR	9 732 639	CHF	10 626 095	02.08.2017
CAD	5 029 755	CHF	3 703 409	02.08.2017
HKD	12 374 682	CHF	1 516 226	02.08.2017
SGD	1 306 324	CHF	907 232	02.08.2017
SEK	4 471 400	CHF	507 595	02.08.2017
EUR	174 600 000	CHF	190 785 420	03.08.2017
EUR	1 749 989	CHF	1 920 000	03.08.2017
CHF	192 700 000	EUR	169 364 030	03.08.2017
EUR	75 650 000	CHF	82 304 931	31.08.2017
EUR	64 300 000	CHF	69 829 800	31.08.2017
AUD	1 420 000	CHF	1 045 617	31.08.2017
CAD	3 070 000	CHF	2 246 933	31.08.2017
HKD	7 220 000	CHF	899 745	31.08.2017
EUR	9 040 000	CHF	9 808 400	31.08.2017
USD	34 830 000	CHF	33 781 617	31.08.2017
GBP	3 470 000	CHF	4 258 384	31.08.2017

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
JPY	1 250 000 000	CHF	10 894 196	31.08.2017
USD	130 000	CHF	124 248	31.08.2017
JPY	21 000 000	CHF	179 841	31.08.2017
CAD	730 000	CHF	530 929	31.08.2017
CHF	2 185 200	EUR	2 000 000	31.08.2017
USD	300 000	CHF	287 190	31.08.2017
GBP	360 000	CHF	452 088	31.08.2017
CAD	1 250 000	CHF	947 125	31.08.2017
CHF	740 111	JPY	87 000 000	31.08.2017
HKD	8 325 000	CHF	1 015 269	31.08.2017
USD	159 196 558	CHF	151 618 802	31.08.2017
EUR	56 666 873	CHF	62 843 562	31.08.2017
GBP	9 461 665	CHF	11 743 819	31.08.2017
EUR	900 000	CHF	1 018 143	31.08.2017
USD	250 000	CHF	243 544	31.08.2017
CHF	562 484	JPY	64 000 000	31.08.2017
EUR	320 000	CHF	362 352	31.08.2017
CHF	508 058	USD	530 000	31.08.2017
CHF	297 141	CAD	390 000	31.08.2017
CHF	66 584 700	EUR	58 500 000	31.08.2017
CHF	151 746 159	USD	159 196 558	31.08.2017
CHF	11 639 740	GBP	9 461 665	31.08.2017
CHF	64 447 235	EUR	56 666 873	31.08.2017
CHF	9 742 872	JPY	1 114 000 000	31.08.2017
CHF	3 559 808	CAD	4 640 000	31.08.2017
CHF	10 608 510	EUR	9 300 000	31.08.2017
CHF	1 078 490	AUD	1 420 000	31.08.2017
CHF	4 717 318	GBP	3 820 000	31.08.2017
CHF	33 405 210	USD	34 950 000	31.08.2017
CHF	1 895 688	HKD	15 520 000	31.08.2017
EUR	168 870 000	CHF	192 038 964	05.09.2017
CAD	4 500 000	CHF	3 466 800	05.09.2017
AUD	1 600 000	CHF	1 229 600	05.09.2017
GBP	4 400 000	CHF	5 592 400	05.09.2017
EUR	8 300 000	CHF	9 435 025	05.09.2017
SGD	1 200 000	CHF	852 031	05.09.2017
USD	30 000 000	CHF	28 885 500	05.09.2017
JPY	222 400 000	CHF	1 938 929	05.09.2017
SEK	3 500 000	CHF	417 255	05.09.2017
HKD	11 000 000	CHF	1 355 849	05.09.2017
JPY	30 000 000	CHF	262 215	05.09.2017
USD	2 000 000	CHF	1 936 400	05.09.2017
EUR	1 300 000	CHF	1 490 938	05.09.2017
CAD	450 000	CHF	346 568	05.09.2017
GBP	480 000	CHF	615 072	05.09.2017
CHF	192 040 000	EUR	167 661 952	05.09.2017
CHF	10 983 360	EUR	9 600 000	05.09.2017
CHF	6 041 440	GBP	4 880 000	05.09.2017
CHF	1 218 880	AUD	1 600 000	05.09.2017
CHF	2 206 679	JPY	252 400 000	05.09.2017
CHF	1 350 688	HKD	11 000 000	05.09.2017
CHF	422 705	SEK	3 500 000	05.09.2017
EUR	875 657	CHF	1 000 000	06.09.2017
EUR	1 684 281	USD	2 000 000	06.09.2017
EUR	173 498	GBP	160 000	06.09.2017
EUR	134 345	CAD	200 000	06.09.2017
EUR	85 700 000	CHF	93 464 420	22.09.2017
USD	162 079 439	CHF	154 194 274	29.09.2017
EUR	55 858 491	CHF	63 499 933	29.09.2017
GBP	9 609 068	CHF	11 809 064	29.09.2017
EUR	2 357 923	CHF	2 728 176	29.09.2017
CHF	4 938 852	USD	5 085 571	29.09.2017
CHF	12 564 817	GBP	9 609 068	29.09.2017
CHF	152 221 254	USD	156 993 868	29.09.2017
CHF	66 704 367	EUR	58 216 414	29.09.2017
CAD	4 800 000	CHF	3 675 600	03.10.2017
AUD	1 700 000	CHF	1 292 170	03.10.2017
SGD	1 200 000	CHF	847 158	03.10.2017
EUR	8 800 000	CHF	10 063 460	03.10.2017
GBP	4 600 000	CHF	5 689 050	03.10.2017
HKD	11 900 000	CHF	1 459 406	03.10.2017
JPY	236 400 000	CHF	2 065 350	03.10.2017
USD	32 600 000	CHF	31 250 360	03.10.2017
SEK	3 500 000	CHF	422 552	03.10.2017
USD	1 650 000	CHF	1 579 875	03.10.2017
EUR	1 200 000	CHF	1 368 900	03.10.2017
GBP	400 000	CHF	497 800	03.10.2017
CAD	250 000	CHF	193 375	03.10.2017
USD	700 000	CHF	667 996	03.10.2017
EUR	170 830 000	CHF	195 583 267	04.10.2017
EUR	1 756 543	CHF	2 000 000	04.10.2017
CHF	197 580 000	EUR	172 393 334	04.10.2017
EUR	74 250 000	CHF	82 391 513	20.10.2017

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	400 000	CHF	443 860	20.10.2017
EUR	57 500 000	CHF	65 396 475	27.10.2017
JPY	1 108 000 000	CHF	9 678 631	27.10.2017
EUR	9 220 000	CHF	10 508 956	27.10.2017
AUD	1 500 000	CHF	1 134 150	27.10.2017
CAD	4 600 000	CHF	3 518 080	27.10.2017
GBP	3 830 000	CHF	4 720 877	27.10.2017
USD	34 980 000	CHF	33 304 458	27.10.2017
HKD	15 570 000	CHF	1 897 392	27.10.2017
EUR	1 300 000	CHF	1 489 670	27.10.2017
GBP	9 747 205	CHF	12 731 312	31.10.2017
USD	157 882 053	CHF	152 728 783	31.10.2017
EUR	58 269 980	CHF	66 738 065	31.10.2017
CHF	2 887 411	EUR	2 521 096	31.10.2017
JPY	260 000 000	CHF	2 232 526	02.11.2017
AUD	1 800 000	CHF	1 363 860	02.11.2017
SEK	3 800 000	CHF	450 424	02.11.2017
USD	34 900 000	CHF	33 688 970	02.11.2017
GBP	4 900 000	CHF	6 353 095	02.11.2017
EUR	10 400 000	CHF	11 889 800	02.11.2017
SGD	1 250 000	CHF	889 110	02.11.2017
CAD	5 300 000	CHF	4 090 540	02.11.2017
HKD	12 000 000	CHF	1 485 608	02.11.2017
EUR	170 200 000	CHF	194 977 716	03.11.2017
EUR	66 000 000	CHF	75 161 460	17.11.2017
EUR	85 700 000	CHF	98 708 403	15.12.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Dem Vermögensverwalter steht eine erfolgsabhängige Vergütung zu.

Diese erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird basierend auf den Nettoinventarwerten der Anlagesegmente täglich berechnet und akkumuliert und jährlich bezahlt.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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: 0,99%
davon anteilige Performance Fee: 0,01%

Auflegungsdatum

1.9.2014

Umrechnungskurse

AUD	1	=	CHF	0.759227	JPY	1	=	CHF 0.008596
CAD	1	=	CHF	0.773678	NOK	1	=	CHF 0.121553
DKK	1	=	CHF	0.153714	NZD	1	=	CHF 0.699478
EUR	1	=	CHF	1.143897	SEK	1	=	CHF 0.118544
GBP	1	=	CHF	1.298181	SGD	1	=	CHF 0.712545
HKD	1	=	CHF	0.123881	USD	1	=	CHF 0.967600

FORTUNA INVEST – Risk Control 4

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		1 259 559 377.72	1 197 335 883.52	1 061 560 782.95
	CH0237262909			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		98.77	97.49	94.88
Anzahl Anteile im Umlauf		12 752 837,0000	12 281 249,0000	11 188 108,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Switzerland Government Bonds	26,62
France, Republic	5,87
Credit Suisse Institutional Fund - Emerging Market Index-D	5,59
Credit Suisse Institutional Fund - Japan Index-ZAH	5,50
Credit Suisse Institutional Fund - Total Market INDEX BLUE ZA	5,45
Credit Suisse Institutional Fund - US INDEX BLUE ZA	4,85
Credit Suisse Institutional Fund - Eurozone Index-ZA	4,38
Italy, Republic	3,98
Credit Suisse Institutional Fund - CSIF EU EX CH RE INDEX Z	2,30
Bundesrepublik Deutschland Government Bond	1,71
Übrige	25,39
Total	**91,64**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	88 759 106.82[1]	210 130 922.47[2]
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	19 493 493.18	0.00
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	786 970 825.18	625 221 007.97
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	356 374 980.00	355 881 560.00
Derivative Finanzinstrumente	7 171 246.94	11 321.10
Sonstige Vermögenswerte	10 039 099.43	9 117 226.23
Gesamtfondsvermögen	**1 268 808 751.55**	**1 200 362 037.77**
Aufgenommene Kredite	-6 050 000.00	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-3 199 373.83	-3 026 154.25
Nettofondsvermögen	**1 259 559 377.72**	**1 197 335 883.52**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	2 715.05	12 559.49
Negativzinsen	-870 750.44	-662 653.22
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	280 797.74	94 239.66
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	7 917 943.23	15 797 432.12
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	5 991 649.79	4 150 274.43
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	159 894.91	1 095 655.50
Total Ertrag	**13 482 250.28**	**20 487 507.98**
Aufwand		
Passivzinsen	-189 516.41	-283 484.10
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-6 155 049.15	-11 358 256.04
Sonstige Aufwendungen	-50.49	-90.40
Total Aufwand	**-6 344 616.05**	**-11 641 830.54**
Nettoertrag	**7 137 634.23**	**8 845 677.44**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-32 549 235.59	2 768 234.56
Realisierter Erfolg	**-25 411 601.36**	**11 613 912.00**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	47 110 955.43	20 846 261.77
Gesamterfolg	**21 699 354.07**	**32 460 173.77**

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	**CHF**
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 197 335 883.52	1 061 560 782.95
Abgeführte Verrechnungssteuer	-5 670 536.61	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	46 194 676.74	103 314 926.80
Gesamterfolg	21 699 354.07	32 460 173.77
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**1 259 559 377.72**	**1 197 335 883.52**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	**Anzahl**
Bestand Anfang Rechnungsjahr	12 281 249,0000	11 188 108,0000
Ausgegebene Anteile	471 588,0000	1 093 141,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**12 752 837,0000**	**12 281 249,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	471 588,0000	1 093 141,0000

[1] Zum 30. September 2017 wurden von EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 6 050 000 als Sicherheiten erhalten.
[2] Zum 31. März 2017 wurden von EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 270 000 als Sicherheiten erhalten.

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Frankreich								
KLEPIERRE EUR1.40*	EUR		39 000		39 000	1 481 564	0,12	
UNIBAIL-RODAMCO EUR5*	EUR		18 000		18 000	4 236 422	0,33	
Total Frankreich						**5 717 985**	**0,45**	
Deutschland								
DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)*	EUR		63 000		63 000	2 588 593	0,20	
Total Deutschland						**2 588 593**	**0,20**	
Grossbritannien								
BRITISH LAND CO PLC REIT*	GBP		178 000		178 000	1 391 078	0,11	
HAMMERSON PLC REIT*	GBP		144 000		144 000	1 003 857	0,08	
LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666*	GBP		133 381		133 381	1 683 908	0,13	
SEGRO PLC ORD GBP0.10*	GBP		174 000		174 000	1 210 735	0,10	
Total Grossbritannien						**5 289 579**	**0,42**	
Total Inhaberaktien						**13 596 157**	**1,07**	
Namensaktien								
Frankreich								
GECINA EUR7.50*	EUR		7 000		7 000	1 098 598	0,09	
Total Frankreich						**1 098 598**	**0,09**	
Deutschland								
LEG IMMOBILIEN AG NPV*	EUR		12 000		12 000	1 174 873	0,09	
VONOVIA SE NPV*	EUR		88 000		88 000	3 623 865	0,29	
Total Deutschland						**4 798 738**	**0,38**	
Total Namensaktien						**5 897 337**	**0,46**	
Anrechte								
Frankreich								
GECINA SA RIGHTS 02.08.17*	EUR		7 000	7 000				
Total Frankreich							**0,00**	
Total Anrechte							**0,00**	
Notes, fester Zins								
EUR								
ACCOR SA-REG-S 2.50000% 13-21.03.19*	EUR	600 000			600 000	712 439	0,06	
AT&T INC 3.15000% 17-04.09.36*	EUR		3 400 000		3 400 000	3 916 124	0,31	
BOUYGUES SA 3.62500% 12-16.01.23*	EUR	600 000			600 000	802 137	0,06	
DEUTSCHE BOERSE AG 1.12500% 13-26.03.18*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 381 379	0,11	
DEUTSCHE BOERSE AG 2.37500% 12-05.10.22*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 537 964	0,20	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.37500% 16-01.06.26*	EUR	1 037 000			1 037 000	1 194 548	0,09	
ENI SPA 4.12500% 09-16.09.19*	EUR	1 400 000		1 400 000				
FCA BANK SPA/IRELAND-REG-S 2.87500% 14-26.01.18*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 154 077	0,09	
FERROVIAL EMISIONES SA-REG-S 3.37500% 13-07.06.21*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 276 268	0,10	
ILLINOIS TOOL WORKS INC 1.25000% 15-22.05.23*	EUR	1 480 000			1 480 000	1 757 655	0,14	
MICROSOFT CORP 2.62500% 13-02.05.33*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 320 068	0,10	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.75000% 14-22.01.19*	EUR	480 000			480 000	563 247	0,04	
SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S- 1.00000% 15-19.01.22*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 170 321	0,09	
TALANX AG 3.12500% 13-13.02.23*	EUR	600 000			600 000	787 463	0,06	
Total EUR						**18 573 691**	**1,46**	
Total Notes, fester Zins						**18 573 691**	**1,46**	
Notes, variabler Zins								
EUR								
AEGON NV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-25.04.44*	EUR	200 000			200 000	249 694	0,02	
BNP PARIBAS CARDIF SA-SUB 4.032%/3M EURIBOR+393BP 14-PRP*	EUR	700 000			700 000	868 389	0,07	
ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.350%/CPI LINKED 14-15.09.24*	EUR	1 800 000	2 000 000		3 800 000	4 994 903	0,39	
NGG FINANCE-REG-S-SUB 4.250%/VAR 13-18.06.76*	EUR	400 000			400 000	495 495	0,04	
Total EUR						**6 608 481**	**0,52**	
Total Notes, variabler Zins						**6 608 481**	**0,52**	
Medium-Term Notes, fester Zins								
EUR								
2I RETE GAS SPA-REG-S 3.00000% 14-16.07.24*	EUR	300 000			300 000	390 574	0,03	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 4.75000% 12-25.10.19*	EUR	300 000			300 000	376 803	0,03	
ABN AMRO BANK NV 2.50000% 13-29.11.23*	EUR	400 000			400 000	511 871	0,04	
ABN AMRO BANK NV 3.62500% 10-06.10.17*	EUR	180 000			180 000	205 967	0,02	
ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.00000% 15-16.04.25*	EUR	1 210 000			1 210 000	1 405 846	0,11	
ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SVS B.V. 4.75000% 11-13.04.18*	EUR	300 000			300 000	351 999	0,03	
AEROPORTI DI ROMA SPA-REG-S 3.25000% 13-20.02.21*	EUR	600 000		450 000	150 000	188 978	0,01	
AIR LIQUIDE FINANCE SA-REG-S 2.12500% 12-15.10.21*	EUR	500 000			500 000	617 653	0,05	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
AKZO NOBEL SWEDEN FINANCE AB-REG-S 2.62500% 12-27.07.22*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 636 813	0,13	
ALLIANZ FINANCE II BV 4.75000% 09-22.07.19*	EUR	3 400 000			3 400 000	4 239 981	0,33	
AMCOR LTD 4.62500% 11-16.04.19*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 225 010	0,10	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.87500% 12-25.09.24*	EUR	4 000 000		4 000 000				
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 2.70000% 14-31.03.26*	EUR	1 480 000			1 480 000	1 923 989	0,15	
APPLE INC 1.00000% 14-10.11.22*	EUR	4 700 000			4 700 000	5 575 292	0,44	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA 5.12500% 09-16.09.24*	EUR	2 200 000		2 200 000				
AUTOROUTES PARIS RHIN RHONE 4.87500% 11-21.01.19*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 217 655	0,10	
AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 5.87500% 04-09.06.24*	EUR	200 000			200 000	303 215	0,02	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 1.37500% 14-10.09.21*	EUR	580 000			580 000	689 600	0,05	
BANK OF TOKYO-MITSUBISHI UFJ LTD-REG-S 0.87500% 15-11.03.22*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 163 446	0,09	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 2.62500% 14-18.03.24*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 407 834	0,11	
BARCLAYS BANK PLC-SUB 6.62500% 11-30.03.22*	EUR	500 000			500 000	704 949	0,06	
BASF SE-REG-S 1.37500% 14-22.01.19*	EUR	600 000			600 000	697 869	0,06	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.37500% 12-19.01.23*	EUR	700 000			700 000	868 990	0,07	
BERTELSMANN SE & CO KGAA-REG-S 1.75000% 14-14.10.24*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 587 532	0,13	
BG ENERGY CAPITAL PLC 3.62500% 10-16.07.19*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 585 985	0,13	
BMW US CAPITAL LLC-REG-S 1.00000% 15-20.04.27*	EUR	370 000			370 000	419 043	0,03	
BNP PARIBAS 2.87500% 13-26.09.23*	EUR	920 000			920 000	1 192 920	0,09	
BNP PARIBAS SA 2.37500% 14-20.05.24*	EUR	900 000			900 000	1 137 482	0,09	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.526% 14-26.09.22*	EUR	920 000			920 000	1 110 403	0,09	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.57300% 15-16.02.27*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 406 197	0,11	
BPCE SA 4.50000% 12-10.02.22*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 628 227	0,13	
CARLSBERG BREWERIES AS 2.62500% 12-03.07.19*	EUR	500 000			500 000	598 973	0,05	
CARLSBERG BREWERIES AS-REG-S 2.50000% 14-28.05.24*	EUR	800 000			800 000	1 006 153	0,08	
CARREFOUR SA 1.75000% 14-15.07.22*	EUR	600 000			600 000	726 036	0,06	
CARREFOUR SA 4.00000% 10-09.04.20*	EUR	460 000			460 000	578 086	0,05	
CIE DE SAINT-GOBAIN SA 4.50000% 11-30.09.19*	EUR	560 000			560 000	698 600	0,06	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-SUB 5.50000% 09-06.08.19*	EUR	900 000			900 000	1 131 562	0,09	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.50000% 17-11.07.22*	EUR		5 900 000		5 900 000	6 773 355	0,53	
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY-REG-S 1.25000% 15-14.04.22*	EUR	800 000			800 000	940 292	0,07	
CRH FINANCE GERMANY GMBH-REG-S 1.75000% 14-16.07.21*	EUR	400 000			400 000	482 139	0,04	
DAIMLER AG-REG-S 2.25000% 14-24.01.22*	EUR	320 000			320 000	397 619	0,03	
DAIMLER AG-REG-S 2.37500% 12-12.09.22*	EUR	1 600 000		1 600 000				
DAIMLER AG-REG-S 2.62500% 12-02.04.19*	EUR	400 000			400 000	476 232	0,04	
DANONE SA-REG-S 1.25000% 15-30.05.24*	EUR	900 000			900 000	1 063 676	0,08	
DANSKE BANK AS-REG-S 0.75000% 15-04.05.20*	EUR	1 500 000		1 500 000				
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.12500% 15-17.03.25*	EUR	300 000			300 000	340 630	0,03	
DEUTSCHE BANK AG-SUB 5.00000% 10-24.06.20*	EUR	700 000			700 000	888 800	0,07	
DEUTSCHE BANK-REG-S 2.37500% 13-11.01.23*	EUR	800 000			800 000	989 214	0,08	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV 4.25000% 10-13.07.22*	EUR	680 000			680 000	921 036	0,07	
DIAGEO FINANCE PLC-REG-S 2.37500% 14-20.05.26*	EUR	800 000			800 000	1 016 082	0,08	
DNB BANK ASA 4.37500% 11-24.02.21*	EUR	1 300 000		1 300 000				
E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.75000% 08-07.05.20*	EUR	2 100 000		2 100 000				
EDP FINANCE BV 4.12500% 13-20.01.21*	EUR	680 000			680 000	876 248	0,07	
ENAGAS FINANCIACIONES SAU-REG-S 1.00000% 15-25.03.23*	EUR		4 600 000		4 600 000	5 384 580	0,42	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.96600% 15-27.01.25*	EUR		2 200 000		2 200 000	2 678 137	0,21	
ENGIE SA-REG-S 2.37500% 14-19.05.26*	EUR	1 600 000		1 600 000				
ENGIE SA-REG-S 5.95000% 11-16.03.11*	EUR	300 000			300 000	577 644	0,05	
ENI SPA 3.62500% 14-29.01.29*	EUR		900 000		900 000	1 230 868	0,10	
ENI SPA 4.00000% 10-29.06.20*	EUR	900 000			900 000	1 140 426	0,09	
ENTE NAZIONALE PER AZIONIL 5.25000% 07-20.06.17*	EUR	23 000		23 000				
EXPERIAN GROUP LTD 4.75000% 10-04.02.20*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 269 188	0,10	
FCE BANK PLC-REG-S 1.13400% 15-10.02.22*	EUR	1 600 000			1 600 000	1 860 251	0,15	
GAS NATURAL CAPITAL MARKETS SA 5.12500% 09-02.11.21*	EUR	700 000		700 000				
GAS NATURAL CAPITAL MARKETS SA 5.00000% 12-13.02.18*	EUR	400 000		200 000	200 000	233 085	0,02	
GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S 3.87500% 13-11.04.22*	EUR	600 000			600 000	794 347	0,06	
GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 6.02500% 08-01.03.38*	EUR	820 000			820 000	1 542 468	0,12	
GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 2.87500% 12-18.06.19*	EUR	400 000			400 000	481 187	0,04	
GECINA SA-REG-S 2.00000% 15-17.06.24*	EUR	700 000			700 000	856 683	0,07	
GENERAL MOTORS FINANCIAL INTERNTL-REG-S 1.87500% 14-15.10.19*	EUR	600 000			600 000	711 691	0,06	
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE-REG-S 2.12500% 14-30.09.24*	EUR	800 000			800 000	969 045	0,08	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.00000% 15-27.07.23*	EUR	400 000			400 000	483 900	0,04	
HEINEKEN NV 2.50000% 12-19.03.19*	EUR	180 000			180 000	213 617	0,02	
HEINEKEN NV-REG-S 2.87500% 12-04.08.25*	EUR	900 000			900 000	1 176 263	0,09	
HSBC FRANCE 1.87500% 13-16.01.20*	EUR	4 700 000			4 700 000	5 613 410	0,44	
HSBC FRANCE SA 0.62500% 15-03.12.20*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 495 691	0,28	
HSBC FRANCE SA 1.62500% 13-03.12.18*	EUR	5 000 000		5 000 000				
IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S 2.50000% 14-24.10.22*	EUR	800 000			800 000	1 010 546	0,08	
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 2.25000% 14-26.02.21*	EUR	500 000			500 000	605 916	0,05	
INNOGY FINANCE BV 6.62500% 08-31.01.19*	EUR	300 000			300 000	373 876	0,03	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.87500% 13-07.11.25*	EUR	400 000			400 000	525 872	0,04	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 1.50000% 15-27.01.25*	EUR	160 000			160 000	189 578	0,01	
KERING SA 3.12500% 12-23.04.19*	EUR	500 000			500 000	600 878	0,05	
KLEPIERRE-REG-S 3.25000% 13-26.02.21*	EUR	1 040 000			1 040 000	1 318 980	0,10	
KONINKLIJKE DSM NV-REG-S 2.37500% 14-03.04.24*	EUR	630 000			630 000	799 761	0,06	
LLOYDS BANK PLC-REG-S 1.00000% 14-19.11.21*	EUR	800 000			800 000	941 628	0,07	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 1.75000% 13-13.11.20*	EUR		4 700 000		4 700 000	5 656 689	0,45	
MACQUARIE BANK LTD-REG-S 2.50000% 13-18.09.18*	EUR	1 500 000		1 500 000				
MADRILENA RED DE GAS FINANCE BV-REG-S 3.77900% 13-11.09.18*	EUR	700 000			700 000	829 234	0,07	
MCDONALD'S CORP-REG-S 1.87500% 15-26.05.27*	EUR	300 000			300 000	359 078	0,03	
MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH-REG-S 1.37500% 15-01.09.22*	EUR	2 240 000			2 240 000	2 698 337	0,21	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.25000% 14-17.09.21*	EUR	130 000			130 000	154 514	0,01	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-SUB 4.62500% 10-10.02.20*	EUR	820 000			820 000	1 035 662	0,08	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 4.00000% 10-13.07.20*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 271 864	0,10	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.62500% 16-10.11.23*	EUR		2 500 000		2 500 000	2 863 231	0,23	
NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 1.50000% 12-19.07.19*	EUR	510 000			510 000	601 881	0,05	
NN GROUP NV-REG-S 1.00000% 15-18.03.22*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 174 816	0,09	
NOMURA EUROPE FINANCE NV-REG-S 1.87500% 13-29.05.18*	EUR	200 000			200 000	231 898	0,02	
NORDEA BANK AB-REG-S 2.00000% 14-17.02.21*	EUR	2 000 000		2 000 000				

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S 2.00000% 14-03.03.21*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 218 639	0,10	
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S 0.87500% 16-21.06.21*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 174 221	0,09	
ORANGE SA 8.12500% 03-28.01.33*	EUR	620 000			620 000	1 312 496	0,10	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26*	EUR	1 180 000			1 180 000	1 535 814	0,12	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOS BK-REG-S LPN 2.32400% 14-23.01.19*	EUR	600 000			600 000	706 757	0,06	
PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 13-23.10.18*	EUR	600 000			600 000	705 947	0,06	
RCI BANQUE SA REG-S 1.12500% 14-30.09.19*	EUR	900 000			900 000	1 052 681	0,08	
RENAULT SA 3.62500% 13-19.09.18*	EUR	300 000			300 000	355 321	0,03	
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 2.25000% 14-10.12.26*	EUR	600 000			600 000	743 215	0,06	
ROBERT BOSCH INVESTMENT NEDERLAND BV 1.62500% 13-24.05.21*	EUR		5 600 000		5 600 000	6 759 167	0,53	
ROCHE FINANCE EUROPE BV 2.00000% 12-25.06.18*	EUR	4 700 000		4 700 000				
ROCHE HOLDINGS INC 6.50000% 09-04.03.21*	EUR	500 000			500 000	699 756	0,06	
ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC 5.37500% 09-30.09.19*	EUR	730 000			730 000	923 802	0,07	
SANOFI-REG-S 1.12500% 14-10.03.22*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 187 914	0,09	
SANOFI-REG-S 1.75000% 14-10.09.26*	EUR	900 000			900 000	1 103 652	0,09	
SANTANDER ISSUANCES SAU-REG-S-SUB 2.50000% 15-18.03.25*	EUR	700 000			700 000	826 111	0,07	
SANTANDER ISSUANCES SAU-REG-S-SUB 3.25000% 16-04.04.26*	EUR	500 000			500 000	615 256	0,05	
SCENTRE GROUP TRUST 1-REG-S 2.25000% 14-16.07.24*	EUR	800 000			800 000	987 952	0,08	
SCHLUMBERGER FINANCE BV-REG-S 1.50000% 13-04.03.19*	EUR	500 000			500 000	585 183	0,05	
SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 1.5000% 15-08.09.23*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 201 183	0,09	
SES SA 4.62500% 10-09.03.20*	EUR	900 000			900 000	1 143 031	0,09	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.62500% 14-24.03.21*	EUR	500 000			500 000	603 348	0,05	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 1.00000% 14-06.04.22*	EUR	800 000			800 000	948 592	0,07	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 1.25000% 15-15.03.22*	EUR	760 000			760 000	910 969	0,07	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 5.62500% 08-11.06.18*	EUR	580 000			580 000	690 476	0,05	
SKY PLC-REG-S 2.50000% 14-15.09.26*	EUR	300 000			300 000	367 640	0,03	
SNAM SPA-REG-S 5.25000% 12-19.09.22*	EUR	1 120 000			1 120 000	1 585 838	0,12	
SWEDBANK AB-REG-S 1.00000% 15-01.06.22*	EUR	1 340 000			1 340 000	1 586 302	0,13	
TELEFONICA EMISIONES SA 4.71000% 12-20.01.20*	EUR	500 000			500 000	633 301	0,05	
TELEFONICA EMISIONES SAU 3.98700% 13-23.01.23*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 337 501	0,11	
TELIASONERA AB-REG-S 3.5000% 13-05.09.33*	EUR	800 000			800 000	1 083 407	0,09	
TELSTRA CORP LTD 2.50000% 13-15.09.23*	EUR	1 300 000		1 300 000				
TELSTRA CORP LTD-REG-S 3.50000% 12-21.09.22*	EUR	220 000			220 000	289 016	0,02	
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONAL SPA-REG-S 0.87500% 15-02.02.22*	EUR	500 000			500 000	585 904	0,05	
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE IV BV 2.87500% 12-15.04.19*	EUR	1 110 000			1 110 000	1 318 280	0,10	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 1.00000% 14-10.09.21*	EUR	660 000			660 000	780 399	0,06	
UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S 2.50000% 14-26.02.24*	EUR	700 000			700 000	896 503	0,07	
VEOLIA ENVIRONNEMENT 6.12500% 03-25.11.33*	EUR	600 000			600 000	1 100 673	0,09	
VESTEDA FINANCE BV-REG-S 1.75000% 14-22.07.19*	EUR	600 000			600 000	703 771	0,06	
VINCI SA 3.37500% 12-30.03.20*	EUR	300 000			300 000	372 211	0,03	
VODAFONE GROUP PLC 5.37500% 07-06.06.22*	EUR	900 000			900 000	1 260 878	0,10	
WELLS FARGO & CO-REG-S 2.25000% 13-02.05.23*	EUR	660 000			660 000	821 372	0,06	
WELLS FARGO & CO-REG-S 2.00000% 15-27.04.26*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 213 846	0,10	
WENDEL SA 5.87500% 12-17.09.19*	EUR	300 000			300 000	382 084	0,03	
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.37500% 17-05.03.23*	EUR		6 000 000		6 000 000	6 798 933	0,54	
YORKSHIRE BUILDING SOCIETY 2.12500% 14-18.03.19*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 180 112	0,09	
Total EUR						**161 923 032**	**12,76**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**161 923 032**	**12,76**	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
EUR								
ACHMEA BV-REG-S-SUB 4.250%/VAR 15-PRP*	EUR	300 000			300 000	360 135	0,03	
ALLIANZ FINANCE II-SUB 5.750%/3M EURIBOR+334.9BP 11-08.07.41*	EUR	1 800 000			1 800 000	2 420 742	0,19	
AQUARIUS + INVESTMENTS PLC-SUB 4.250%/VAR 13-02.10.43*	EUR	680 000			680 000	901 085	0,07	
ASS GENERALI-REG-S-SUB 7.750%/3M EURIBOR+711.3BP 12-12.12.42*	EUR	400 000			400 000	572 497	0,05	
AVIVA PLC-REG-S-SUB 3.375%/VAR 15-04.12.45*	EUR	510 000			510 000	614 949	0,05	
AXA SA-REG-S SUB VAR 14-PRP*	EUR	780 000			780 000	986 085	0,08	
BAYER AG-REG-S-SUB 3.000%/VAR 14-01.07.75*	EUR	700 000			700 000	839 691	0,07	
BERTELSMANN SE & CO KGAA-REG-S-SUB 3.500%/VAR 15-23.04.75*	EUR	300 000			300 000	351 268	0,03	
BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 14-20.03.26*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 219 463	0,10	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE VAR/LINKED RATING 03-24.01.33*	EUR	500 000			500 000	981 248	0,08	
ING BANK NV-SUB 3.625%/VAR 14-25.02.26*	EUR	760 000			760 000	952 916	0,08	
MUENCHENER RUECKVER-SUB 6.250%/VAR 12-26.05.42*	EUR	600 000			600 000	848 815	0,07	
OMV AG-SUB 6.750%/VAR 11-PRP*	EUR	400 000			400 000	473 990	0,04	
ORANGE SA REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP*	EUR	600 000			600 000	785 184	0,06	
STANDARD CHARTERED-SUB 4.000%/VAR 13-21.10.25*	EUR	720 000			720 000	897 788	0,07	
TOTAL SA-REG-S-SUB 2.250%/VAR 15-PRP*	EUR	500 000			500 000	588 129	0,05	
TOTAL SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 390 109	0,11	
UNIQA INSURANCE GRP-SUB 6.875%/3M EURIBOR+596BP 13-31.07.43*	EUR	600 000			600 000	847 250	0,07	
XSTRATA FINANCE DUBAI LTD STEP UP 12-19.11.18*	EUR	700 000			700 000	823 356	0,06	
Total EUR						**16 854 699**	**1,33**	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						**16 854 699**	**1,33**	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
SWITZERLAND 1.25000% 12-11.06.24*	CHF		61 000 000		61 000 000	67 459 900	5,32	
SWITZERLAND 2.00000% 10-28.04.21*	CHF	65 000 000	14 000 000		79 000 000	86 481 300	6,82	
SWITZERLAND 2.00000% 11-25.05.22*	CHF	59 000 000	12 000 000		71 000 000	79 370 900	6,26	
SWITZERLAND 2.25000% 05-06.07.20*	CHF	72 000 000	9 000 000	81 000 000				
SWITZERLAND 4.00000% 98-11.02.23*	CHF	70 000 000	14 000 000		84 000 000	104 244 000	8,22	
Total CHF						**337 556 100**	**26,60**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
EUR								
APPLE INC 0.87500% 17-24.05.25*	EUR		9 600 000		9 600 000	11 043 014	0,87	
APPLE INC 2.00000% 15-17.09.27*	EUR	700 000			700 000	866 291	0,07	
APT PIPELINES LTD-REG-S 1.37500% 15-22.03.22*	EUR	500 000			500 000	591 097	0,05	
AT&T INC 1.45000% 14-01.06.22*	EUR	2 200 000		2 200 000				
AT&T INC 2.40000% 14-15.03.24*	EUR	820 000			820 000	1 014 245	0,08	
BANK OF IRELAND-REG-S 3.25000% 14-15.01.19*	EUR	900 000			900 000	1 073 601	0,08	
BASF SE 2.00000% 12-05.12.22*	EUR	260 000			260 000	324 329	0,03	
BERKSHIRE HATHAWAY INC 1.12500% 15-16.03.27*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 245 943	0,10	
BMW FINANCE NV 2.37500% 13-24.01.23*	EUR	1 400 000			1 400 000	1 765 669	0,14	
CIE FINANCIERE INDUSTRIELLE AUTOROUTES 5.00000% 06-24.05.21*	EUR	500 000			500 000	672 802	0,05	
COCA-COLA CO/THE 0.75000% 15-09.03.23*	EUR	4 900 000			4 900 000	5 690 291	0,45	
COCA-COLA CO/THE-REG-S 1.12500% 15-09.03.27*	EUR	1 780 000			1 780 000	2 042 570	0,16	
DH EUROPE FINANCE SA 2.50000% 15-08.07.25*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 272 665	0,10	
ELI LILLY & CO 2.12500% 15-03.06.30*	EUR	500 000			500 000	603 823	0,05	
EUTELSAT SA-REG-S 2.62500% 13-13.01.20*	EUR	500 000			500 000	601 690	0,05	
EUTELSTAT SA 5.00000% 11-14.01.19*	EUR	700 000			700 000	852 351	0,07	
GENERAL ELECTRIC CO 1.25000% 15-26.05.23*	EUR	3 300 000			3 300 000	3 929 779	0,31	
GENERAL MILLS INC 1.00000% 15-27.04.23*	EUR	500 000			500 000	581 111	0,05	
GROUPE BPCE-REG-S-SUB 4.62500% 13-18.07.23*	EUR		700 000		700 000	951 345	0,07	
HAMMERSON PLC 2.75000% 12-26.09.19*	EUR	500 000			500 000	602 896	0,05	
HIT FINANCE BV 4.87500% 06-27.10.21*	EUR	1 500 000		1 500 000				
INMOBILIARIA COLONIAL SA-REG-S 1.86300% 15-05.06.19*	EUR	500 000			500 000	589 427	0,05	
INTESA SANPAOLO SPA 4.00000% 10-08.11.18*	EUR	400 000			400 000	477 925	0,04	
INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 1.12500% 15-04.03.22*	EUR	700 000			700 000	817 399	0,06	
JAB HOLDINGS BV-REG-S 2.12500% 15-16.09.22*	EUR	1 200 000			1 200 000	1 475 476	0,12	
JOHNSON & JOHNSON 4.75000% 07-06.11.19*	EUR		5 200 000		5 200 000	6 571 165	0,52	
MERCK & CO INC 2.50000% 14-15.10.34*	EUR	250 000			250 000	323 337	0,03	
MICROSOFT CORP 3.12500% 13-06.12.28*	EUR	4 600 000			4 600 000	6 366 771	0,50	
MONDELEZ INTL 1.00000% 15-07.03.22*	EUR	1 140 000			1 140 000	1 333 957	0,11	
MORGAN STANLEY 1.87500% 14-30.03.23*	EUR	720 000			720 000	870 205	0,07	
O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FIN-REG-S 2.37500% 14-10.02.21*	EUR	400 000			400 000	490 398	0,04	
ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 13-04.10.21*	EUR	450 000			450 000	575 633	0,05	
PERNOD RICARD SA-REG-S 2.12500% 14-27.09.24*	EUR	800 000			800 000	989 205	0,08	
PPG INDUSTRIES INC 0.87500% 15-13.03.22*	EUR	990 000			990 000	1 155 356	0,09	
PRICELINE.COM INC 1.80000% 15-03.03.27*	EUR	400 000			400 000	461 787	0,04	
RABOBANK NEDERLAND NV 4.12500% 10-14.07.25*	EUR	1 180 000			1 180 000	1 683 549	0,13	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.90000% 15-18.02.20*	EUR	800 000			800 000	932 239	0,07	
UBS GROUP FUNDING SWISS AG-REG-S 1.75000% 15-16.11.22*	EUR	500 000			500 000	603 403	0,05	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.62500% 14-01.03.24*	EUR	500 000			500 000	593 711	0,05	
WELLCOME TRUST LTD-REG-S 1.12500% 15-21.01.27*	EUR	7 000 000	4 100 000		11 100 000	12 775 342	1,01	
Total EUR						**74 811 797**	**5,90**	
Total Anleihen, fester Zins						**412 367 897**	**32,50**	
Anleihen, variabler Zins								
EUR								
ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.375%/VAR PRP*	EUR	300 000			300 000	371 405	0,03	
AMERICA MOVIL SAB DE CV-REG-S-SUB 5.12500% 13-06.09.73*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 186 793	0,09	
AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.375%/VAR-REG-S-SUB 13-06.09.73*	EUR	1 500 000			1 500 000	2 048 290	0,16	
BAYER AG-REG-S-SUB 3.750/VAR 14-01.07.74*	EUR	200 000			200 000	249 022	0,02	
CNP ASSURANCES-REG-S-SUB 4.250%/VAR 14-05.06.45*	EUR	500 000			500 000	638 941	0,05	
CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-PRP*	EUR	700 000			700 000	881 921	0,07	
DEUTSCHE BOERSE AG-REG-S-SUB 2.750%/VAR 15-05.02.41*	EUR	700 000			700 000	854 721	0,07	
ELM BV-REG-S-SUB 2.600%/VAR 15-PRP*	EUR	200 000			200 000	230 923	0,02	
ENGIE SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 14-PRP*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 189 675	0,09	
ENGIE SA-REG-S-SUB 3.87500%/VAR 14-PRP*	EUR	400 000			400 000	502 061	0,04	
FRANCE, REPUBLIC OF 1.100%/CPTFEMU LINKED 09-25.07.22*	EUR	2 400 000	2 700 000		5 100 000	7 222 305	0,57	
FRANCE, REPUBLIC OF 1.850%/CPTFEMU LINKED 10-25.07.27*	EUR	1 900 000	2 800 000		4 700 000	7 305 846	0,58	
FRANCE, REPUBLIC OF 0.250%/CPTFEMU LINKED 12-25.07.18*	EUR	1 500 000	500 000		2 000 000	2 462 238	0,19	
FRANCE, REPUBLIC OF 0.250%/CPTFEMU LINKED 13-25.07.24*	EUR	1 800 000	2 100 000		3 900 000	5 026 649	0,40	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.400%/CPI LINKED 99-25.07.29*	EUR	1 200 000	1 300 000		2 500 000	5 362 475	0,42	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.150%/INFLATION IDX LKD 02-25.07.32*	EUR	1 400 000	1 500 000		2 900 000	6 388 505	0,50	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.250%/INFLATION IDX LKD 03-25.07.20*	EUR	2 700 000	3 100 000		5 800 000	9 148 104	0,72	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.800%/INFLATION IDX LKD 07-25.07.40*	EUR	1 500 000	1 800 000		3 300 000	6 329 951	0,50	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.100%/CPI LINKED 08-25.07.23*	EUR	2 000 000	2 500 000		4 500 000	6 849 801	0,54	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.300%/INFLATION IDX LKD 09-25.07.19*	EUR	1 600 000	1 700 000		3 300 000	4 300 122	0,34	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.100%/CPI LINKED 12-25.07.21*	EUR	900 000	1 300 000		2 200 000	2 724 304	0,21	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.700%/CPI LINKED 14-25.07.30*	EUR	1 100 000	1 500 000		2 600 000	3 460 398	0,27	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.100%/CPI LINKED 15-01.03.25*	EUR	900 000	1 400 000		2 300 000	2 856 792	0,23	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.100%/INF LK 16-25.07.47*	EUR	600 000	1 200 000		1 800 000	2 119 212	0,17	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.100%/CPI LINKED 17-01.03.28*	EUR		1 100 000		1 100 000	1 348 527	0,11	
FRANCE,REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.100%/CPI LINKED 16-01.03.21*	EUR	600 000	700 000		1 300 000	1 594 458	0,13	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.750%/ INFLATION INDX LKD 09-15.04.20*	EUR	2 200 000	3 300 000	1 000 000	4 500 000	6 199 884	0,49	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.750%/INFLATION INDX LKD 11-15.04.18*	EUR	2 000 000		2 000 000				
GERMANY, REPUBLIC OF 0.100%/CPI LINKED 12-15.04.23*	EUR	2 200 000	2 300 000		4 500 000	5 825 110	0,46	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.500%/CPI LINKED 14-15.04.30*	EUR	1 100 000	1 500 000		2 600 000	3 489 303	0,28	
GERMANY, REPUBLIC OF 0.100%/CPI LINKED 15-15.04.26*	EUR	1 100 000	2 000 000		3 100 000	3 974 915	0,31	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.100%/CPI LINKED 15-15.04.46*	EUR	700 000	1 000 000		1 700 000	2 251 096	0,18	
ITALY, REPUBLIC OF 1.700%/CPI LINKED 13-15.09.18*	EUR	1 500 000	600 000		2 100 000	2 537 315	0,20	
ITALY, REPUBLIC OF 2.350%/CPI LINKED 08-15.09.19*	EUR	2 300 000	2 600 000		4 900 000	6 729 079	0,53	
ITALY, REPUBLIC OF 2.550%/CPI LINKED 09-15.09.41*	EUR	1 100 000	1 400 000		2 500 000	3 661 461	0,29	
ITALY, REPUBLIC OF 3.100%/CPI LINKED 11-15.09.26*	EUR	1 600 000	2 000 000		3 600 000	5 301 873	0,42	
ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.300%/CPI LINKED 17-15.05.28*	EUR		1 600 000		1 600 000	1 886 657	0,15	
ITALY, REPUBLIC OF-BTPS 2.350%/CPI LINKED 04-15.09.35*	EUR	1 800 000	1 900 000		3 700 000	5 970 777	0,47	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.600%/CPI LINKED 07-15.09.23*	EUR	2 400 000	2 600 000		5 000 000	7 594 861	0,60	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.100%/CPI LINKED 10-15.09.21*	EUR	2 300 000	2 600 000		4 900 000	6 802 340	0,54	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ITALY,REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.250%/CPI LKD 15-15.09.32*	EUR	900 000	1 400 000		2 300 000	2 647 611	0,21	
ITALY,REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 0.100%/CPI LKD 16-15.05.22*	EUR	700 000	1 300 000		2 000 000	2 367 249	0,19	
NN GROUP NV-REG-S-SUB 4.500/VAR 14-PRP*	EUR	200 000			200 000	250 010	0,02	
ORANGE-SUB-REG-S 5.25000%/VAR 14-PRP*	EUR	500 000			500 000	659 170	0,05	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 14-26.05.26*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 572 304	0,12	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 14-16.09.26*	EUR	700 000			700 000	844 439	0,07	
SOGECAP SA-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP*	EUR	600 000			600 000	746 180	0,06	
SPAIN GOVERNMENT 0.300%/CPI LINKED 15-30.11.21*	EUR	400 000	700 000		1 100 000	1 347 368	0,11	
SPAIN GOVERNMENT-144A-REG-S 1.800%/CPI LINKED 14-30.11.24*	EUR	1 500 000	2 100 000		3 600 000	4 777 380	0,38	
SPAIN GOVERNMENT-144A-REG-S 0.550%/CPI LINKED 13-30.11.19*	EUR	1 300 000	1 400 000		2 700 000	3 265 979	0,26	
SPAIN GOVERNMENT-144A-REG-S 1.000%/CPI LINKED 15-30.11.30*	EUR	700 000	1 200 000		1 900 000	2 280 228	0,18	
SPAIN GOVERNMENT-144A-REG-S 0.650%/CPI LINKED 17-30.11.27*	EUR		1 400 000		1 400 000	1 658 923	0,13	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-SUB 2.65600%/FLR 14-15.01.24*	EUR	980 000			980 000	1 155 759	0,09	
VIENNA INSR-REG-S-SUB 3.750%/3M EURIBOR+393.9BP 15-02.03.46*	EUR	800 000			800 000	997 670	0,08	
Total EUR						**169 448 384**	**13,35**	
Total Anleihen, variabler Zins						**169 448 384**	**13,35**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**805 269 678**	**63,47**	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Medium-Term Notes, fester Zins								
EUR								
COMPASS GROUP PLC 3.12500% 12-13.02.19*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 194 640	0,09	
Total EUR						**1 194 640**	**0,09**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**1 194 640**	**0,09**	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**1 194 640**	**0,09**	

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

Inhaberaktien								
Grossbritannien								
LAND SECURITIES GROUP PLC REIT**	GBP		142 273	142 273				
Total Grossbritannien							**0,00**	
Total Inhaberaktien							**0,00**	
Investmentzertifikate, open end								
Eurozone								
CREDIT SUISSE INST FUND-EUROZONE INDEX-ZA**	CHF	76 500	6 000	28 500	54 000	55 621 080	4,38	
Total Eurozone						**55 621 080**	**4,38**	
Global								
CREDIT SUISSE INST FUND-EMERGING MARKET INDEX-D**	CHF	35 000	3 000		38 000	70 982 100	5,59	
CREDIT SUISSE INSTITUTIONAL FUND - CSIF EU EX CH RE INDEX ZA**	CHF	46 000	8 000		54 000	29 232 360	2,30	
Total Global						**100 214 460**	**7,90**	
Japan								
CREDIT SUISSE INSTITUTIONAL FUND - JAPAN INDEX-ZAH**	CHF	60 000	17 000	18 000	59 000	69 846 560	5,50	
Total Japan						**69 846 560**	**5,50**	
Schweiz								
CSIF SWITZERLAND TOTAL MARKET INDEX BLUE-ZA**	CHF	65 000	6 000	10 000	61 000	69 138 010	5,45	
Total Schweiz						**69 138 010**	**5,45**	
Vereinigte Staaten								
CSIF US INDEX BLUE-ZA**	CHF	43 000		4 000	39 000	61 554 870	4,84	
Total Vereinigte Staaten						**61 554 870**	**4,84**	
Total Investmentzertifikate, open end						**356 374 980**	**28,08**	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**356 374 980**	**28,08**	
Total Wertschriften						**1 162 839 298**	**91,64**	
(davon ausgeliehen							0,00)	
Bankguthaben auf Sicht						88 759 107	7,00	
Derivative Finanzinstrumente						7 171 247	0,57	
Sonstige Vermögenswerte						10 039 100	0,79	
Gesamtfondsvermögen						**1 268 808 752**	**100,00**	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-6 050 000		
Andere Verbindlichkeiten						-3 199 374		
Nettofondsvermögen						**1 259 559 378**		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamtfondsvermögens[3]	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	806 464 318	63,56	625 221 008	52,09
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	363 546 227	28,65	355 892 881	29,64
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**1 170 010 545**	**92,21**	**981 113 889**	**81,73**

[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 / Scheinlagen
[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 Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	467 000 000	CHF	540 786 000	25.10.2017	6 760 371	0.53
USD	71 000 000	CHF	68 845 150	25.10.2017	258 379	0.02
GBP	10 000 000	CHF	13 123 500	25.10.2017	152 497	0.02
					7 171 247	0.57

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	376 000 000	CHF	402 019 200	24.05.2017
GBP	5 000 000	CHF	6 377 500	24.05.2017
USD	70 000 000	CHF	69 720 000	24.05.2017
GBP	4 500 000	CHF	5 764 500	24.05.2017
EUR	3 000 000	CHF	3 254 550	24.05.2017
EUR	379 000 000	CHF	414 019 600	20.06.2017
GBP	9 500 000	CHF	11 970 000	20.06.2017
USD	70 000 000	CHF	67 900 000	20.06.2017
EUR	7 000 000	CHF	7 619 500	20.06.2017
EUR	31 000 000	CHF	33 644 300	20.06.2017
EUR	417 000 000	CHF	453 716 850	20.07.2017
GBP	9 500 000	CHF	11 811 350	20.07.2017
USD	70 000 000	CHF	68 075 000	20.07.2017
EUR	7 000 000	CHF	7 712 775	20.07.2017
EUR	429 000 000	CHF	472 830 930	25.08.2017
GBP	10 500 000	CHF	13 062 000	25.08.2017
USD	74 000 000	CHF	70 464 650	25.08.2017
EUR	27 500 000	CHF	31 515 000	25.08.2017
EUR	458 000 000	CHF	520 997 900	22.09.2017
GBP	10 500 000	CHF	12 967 500	22.09.2017
USD	74 000 000	CHF	71 336 000	22.09.2017
EUR	9 000 000	CHF	10 259 100	22.09.2017
CHF	2 877 300	USD	3 000 000	22.09.2017
EUR	467 000 000	CHF	540 786 000	25.10.2017
USD	71 000 000	CHF	68 845 150	25.10.2017
GBP	10 000 000	CHF	13 123 500	25.10.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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.

Zusammengesetzte
TER für die letzten 12 Monate: 1,01%

Auflegungsdatum

1.9.2014

Umrechnungskurse

EUR	1	=	CHF	1.143897	USD	1	=	CHF 0.967600
GBP	1	=	CHF	1.298181				

FORTUNA INVEST – Risk Control 5

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		1 272 032 032.07	1 213 339 650.37	1 090 992 074.88
	CH0237262933			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		100.61	99.48	98.51
Anzahl Anteile im Umlauf		12 643 730,0000	12 196 366,0000	11 075 322,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Emittenten in % des Gesamtfondsvermögens	
United States Treasury	22,10
German Treasury Bill	12,16
Belgium Treasury Bill	11,90
Spain Letras del Tes	8,99
Dutch Treasury Bill	8,82
Italy Buoni Ordinari	7,68
France Treasury Bill	6,10
Swiss Confederation	3,95
United Kingdom Gilt	3,75
Übrige	9,29
Total	**94,74**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	60 438 580.04[1]	45 412 021.75[2]
Geldmarktinstrumente	780 843 101.38	758 830 456.44
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	435 604 975.64	413 289 461.40
Derivative Finanzinstrumente	3 642 178.02	1 431 849.99
Sonstige Vermögenswerte	3 442 187.03	3 482 784.46
Gesamtfondsvermögen	**1 283 971 022.11**	**1 222 446 574.04**
Aufgenommene Kredite	-8 761 594.10	-6 113 542.97
Andere Verbindlichkeiten	-3 177 395.94	-2 993 380.70
Nettofondsvermögen	**1 272 032 032.07**	**1 213 339 650.37**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	95 424.35	100 305.69
Negativzinsen	-58 275.05	-73 448.98
Erträge der Geldmarktinstrumente	-2 104 268.89	0.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	4 968 011.21	8 504 058.87
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	-46 556.40	-207 406.37
Total Ertrag	**2 854 335.22**	**8 323 509.21**
Aufwand		
Passivzinsen	-11 520.12	-29 459.84
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-6 224 836.88	-11 606 808.42
Sonstige Aufwendungen	-81.09	-90.89
Total Aufwand	**-6 236 438.09**	**-11 636 359.15**
Nettoertrag	**-3 382 102.87**	**-3 312 849.94**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-5 959 118.89	27 603 157.01
Realisierter Erfolg	**-9 341 221.76**	**24 290 307.07**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	23 188 291.76	-12 803 185.60
Gesamterfolg	**13 847 070.00**	**11 487 121.47**

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	**CHF**
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 213 339 650.37	1 090 992 074.88
Saldo aus dem Anteilverkehr	44 845 311.70	110 860 454.02
Gesamterfolg	13 847 070.00	11 487 121.47
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**1 272 032 032.07**	**1 213 339 650.37**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	**Anzahl**
Bestand Anfang Rechnungsjahr	12 196 366,0000	11 075 322,0000
Ausgegebene Anteile	447 364,0000	1 121 044,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**12 643 730,0000**	**12 196 366,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	447 364,0000	1 121 044,0000

[1] Zum 30. September 2017 wurden gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 5 260 000 als Sicherheiten hinterlegt.
[2] Zum 31. März 2017 wurden gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 1 090 000 als Sicherheiten hinterlegt.

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Anleihen, fester Zins								
AUD								
AUSTRALIA 1.75000% 15-21.11.20*	AUD		7 930 000		7 930 000	5 948 244	0,46	
AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27*	AUD		3 965 000		3 965 000	2 985 652	0,23	
AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39*	AUD		1 128 000		1 128 000	833 431	0,06	
Total AUD						**9 767 327**	**0,76**	
CAD								
CANADA, GOVERNMENT 0.75000% 15-01.09.20*	CAD		7 359 000		7 359 000	5 558 836	0,43	
CANADA, GOVERNMENT 5.75000% 98-01.06.29*	CAD	3 540 000		203 000	3 337 000	3 518 887	0,27	
Total CAD						**9 077 723**	**0,71**	
CHF								
SWITZERLAND 1.25000% 12-11.06.24*	CHF	16 950 000			16 950 000	18 745 005	1,46	
SWITZERLAND 1.50000% 13-24.07.25*	CHF	14 500 000			14 500 000	16 435 750	1,28	
SWITZERLAND 2.00000% 11-25.05.22*	CHF	13 849 000			13 849 000	15 481 797	1,21	
Total CHF						**50 662 552**	**3,95**	
EUR								
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.25000% 03-25.04.19*	EUR	10 122 000	348 000	300 000	10 170 000	12 518 734	0,98	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 05-25.04.55*	EUR	1 886 000	66 000		1 952 000	3 485 418	0,27	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 13-25.05.23*	EUR	13 185 000		422 000	12 763 000	16 049 728	1,25	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.50000% 13-25.05.30*	EUR	10 498 000		1 894 000	8 604 000	11 529 612	0,90	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.25000% 15-25.05.36*	EUR	409 983	2 176 836		2 586 819	2 858 860	0,22	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 17-15.02.27*	EUR		1 700 000		1 700 000	1 920 161	0,15	
GERMANY, REPUBLIC OF 6.25000% 94-04.01.24*	EUR	9 071 000	1 434 620	980 000	9 525 620	15 214 539	1,18	
GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 03-04.07.34*	EUR	2 355 000		498 000	1 857 000	3 409 746	0,27	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 10-04.07.42*	EUR	2 834 000	100 000	7 000	2 927 000	4 860 695	0,38	
GERMANY, REPUBLIC OF 1.00000% 13-12.10.18*	EUR	9 180 000		2 905 762	6 274 238	7 305 263	0,57	
Total EUR						**79 152 755**	**6,16**	
GBP								
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 05-07.12.55*	GBP	3 154 000	109 991	129 000	3 134 991	6 833 087	0,53	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 06-07.12.46*	GBP	3 659 000		356 000	3 303 000	6 503 658	0,51	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.75000% 07-07.12.30*	GBP	5 802 000		151 000	5 651 000	10 103 795	0,79	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 08-07.03.19*	GBP	1 329 000	929 000	948 894	1 309 106	1 798 404	0,14	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.50000% 09-07.09.34*	GBP	3 364 000		1 166 000	2 198 000	3 988 775	0,31	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 10-07.12.40*	GBP	637 000	1 221 000		1 858 000	3 463 178	0,27	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.75000% 12-07.09.22*	GBP		4 784 000		4 784 000	6 503 383	0,51	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.50000% 16-22.07.22*	GBP	2 691 000		2 691 000				
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 2.00000% 14-22.07.20*	GBP	9 746 000		3 104 000	6 642 000	8 974 141	0,70	
Total GBP						**48 168 419**	**3,75**	
Total Anleihen, fester Zins						**196 828 777**	**15,33**	
Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 8.12500% 89-15.08.19*	USD	20 000 000			20 000 000	21 730 187	1,69	
AMERICA, UNITED STATES OF 5.25000% 99-15.02.29*	USD	9 223 000	324 400	1 248 000	8 299 400	10 342 721	0,81	
AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 06-15.02.36*	USD	4 654 400	124 000		4 778 400	5 947 260	0,46	
AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 14-15.08.44*	USD	22 960 000		2 757 000	20 203 000	20 622 824	1,61	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 16-15.11.46*	USD	841 000	3 493 400		4 334 400	4 208 875	0,33	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 16-15.08.26*	USD		5 609 700		5 609 700	5 082 549	0,40	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 11-30.09.18*	USD	20 304 000	7 458 000	14 387 500	13 374 500	12 940 662	1,01	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 11-15.11.21*	USD	18 895 000		2 596 000	16 299 000	15 892 885	1,24	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 16-31.10.21*	USD		19 836 000		19 836 000	18 764 458	1,46	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 16-30.11.18*	USD	14 481 000		14 481 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 16-30.11.21*	USD	8 492 400	9 000 000	17 492 400				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 17-31.05.22*	USD		11 569 300		11 569 300	11 121 433	0,87	
Total USD						**126 653 853**	**9,86**	
Total Treasury-Notes, fester Zins						**126 653 853**	**9,86**	
Treasury-Notes, variabler Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 12-15.01.22*	USD		10 000 000		10 000 000	10 498 631	0,82	
Total USD						**10 498 631**	**0,82**	
Total Treasury-Notes, variabler Zins						**10 498 631**	**0,82**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**333 981 261**	**26,01**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden								
Anleihen, fester Zins								
CAD								
CANADA, GOVERNMENT 0.75000% 15-01.03.21*	CAD	2 019 000		2 019 000				
CANADA, GOVERNMENT 0.50000% 16-01.08.18*	CAD	5 090 000		5 090 000				
CANADA, GOVERNMENT 2.75000% 14-01.12.48*	CAD	1 105 000		124 000	981 000	804 469	0,06	
Total CAD						**804 469**	**0,06**	
Total Anleihen, fester Zins						**804 469**	**0,06**	
Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 13-31.12.20*	USD	25 512 000		4 972 000	20 540 000	20 307 709	1,58	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 14-30.09.19*	USD	17 145 000	5 188 000		22 333 000	21 718 301	1,69	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 12-15.11.22*	USD	23 273 000		2 829 000	20 444 000	19 474 070	1,52	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 13-29.02.20*	USD	21 841 000		375 000	21 466 000	20 626 084	1,61	
Total USD						**82 126 163**	**6,40**	
Total Treasury-Notes, fester Zins						**82 126 163**	**6,40**	
Treasury-Notes, variabler Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 16-15.04.21*	USD		10 000 000		10 000 000	10 025 767	0,78	
Total USD						**10 025 767**	**0,78**	
Total Treasury-Notes, variabler Zins						**10 025 767**	**0,78**	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**92 956 399**	**7,24**	
Nicht-Effekten								
Treasury-Bills, Nullcoupon								
EUR								
BELGIUM, KINGDOM OF TB 0.00000% 14.04.16-13.04.17**	EUR	50 000 000		50 000 000				
BELGIUM, KINGDOM OF TB 0.00000% 12.05.16-11.05.17**	EUR	50 500 000		50 500 000				
BELGIUM, KINGDOM OF TB 0.00000% 14.07.16-13.07.17**	EUR		50 000 000	50 000 000				
BELGIUM, KINGDOM OF TB 0.00000% 13.10.16-12.10.17**	EUR		50 500 000		50 500 000	57 777 182	4,50	
BELGIUM, KINGDOM OF TB 0.00000% 12.01.17-11.01.18**	EUR		50 000 000		50 000 000	57 297 787	4,46	
BELGIUM, KINGDOM OF TB 0.00000% 09.03.17-08.03.18**	EUR		32 900 000		32 900 000	37 738 035	2,94	
FRANCE, REPUBLIC OF BTF-REG-S TB 0.00000% 04.01.17-08.06.17**	EUR	50 000 000		50 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF BTF-REG-S TB 0.00000% 04.01.17-05.04.17**	EUR	45 400 000		45 400 000				
FRANCE, REPUBLIC OF BTF-REG-S TB 0.00000% 08.03.17-28.02.18**	EUR		45 400 000		45 400 000	52 066 898	4,06	
FRANCE, REPUBLIC OF BTF-REG-S TB 0.00000% 22.03.17-30.08.17**	EUR		45 400 000	45 400 000				
FRANCE, REPUBLIC OF BTF-REG-S TB 0.00000% 05.04.17-28.03.18**	EUR		22 900 000		22 900 000	26 276 178	2,05	
GERMANY, REPUBLIC OF TB-REG-S 0.00000% 24.08.16-23.08.17**	EUR	50 000 000		50 000 000				
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S TB 0.00000% 15.03.17-13.09.17**	EUR	45 000 000		45 000 000				
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S TB 0.00000% 10.05.17-15.11.17**	EUR		51 200 000		51 200 000	58 617 880	4,57	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S TB 0.00000% 12.07.17-10.01.18**	EUR		40 000 000		40 000 000	45 854 244	3,57	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S TB 0.00000% 16.08.17-14.02.18**	EUR		45 000 000		45 000 000	51 624 631	4,02	
ITALY, REPUBLIC OF TB 0.00000% 13.05.16-12.05.17**	EUR	47 500 000		47 500 000				
ITALY, REPUBLIC OF TB 0.00000% 31.10.16-28.04.17**	EUR	30 600 000	8 000 000	38 600 000				
ITALY, REPUBLIC OF TB 0.00000% 14.12.16-14.12.17**	EUR		47 500 000		47 500 000	54 379 649	4,24	
ITALY, REPUBLIC OF TB 0.00000% 02.01.17-30.06.17**	EUR	47 500 000		47 500 000				
ITALY, REPUBLIC OF TB 0.00000% 28.02.17-31.08.17**	EUR		38 600 000	38 600 000				
ITALY, REPUBLIC OF TB 0.00000% 31.08.17-28.02.18**	EUR		38 600 000		38 600 000	44 225 502	3,44	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE TB 0.00000% 04.01.17-30.06.17**	EUR	56 170 000		56 170 000				
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE TB 0.00000% 05.04.17-29.09.17**	EUR		57 400 000	57 400 000				
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE TB 0.00000% 04.05.17-31.10.17**	EUR		51 200 000		51 200 000	58 596 796	4,56	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE TB 0.00000% 08.06.17-30.11.17**	EUR		62 770 000	15 000 000	47 770 000	54 704 601	4,26	
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 13.05.16-12.05.17**	EUR	50 000 000		50 000 000				
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 15.07.16-14.07.17**	EUR	96 580 000		96 580 000				
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 19.08.16-18.08.17**	EUR	32 000 000	7 270 000	39 270 000				
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 14.10.17-13.10.17**	EUR		50 000 000	14 000 000	36 000 000	41 186 459	3,21	
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 09.12.16-08.12.17**	EUR		36 580 000		36 580 000	41 878 472	3,26	
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 17.02.17-16.02.18**	EUR		28 270 000		28 270 000	32 392 611	2,52	
Total EUR						**714 616 926**	**55,66**	
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 08.12.16-07.12.17**	USD		60 790 000		60 790 000	58 708 104	4,57	
AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 08.12.16-08.06.17**	USD	60 790 000		60 790 000				
AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 10.08.17-08.02.18**	USD		7 800 000		7 800 000	7 518 072	0,59	
Total USD						**66 226 176**	**5,16**	
Total Treasury-Bills, Nullcoupon						**780 843 101**	**60,81**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 2.12500% 15-15.05.25**	USD	10 741 000		1 725 000	9 016 000	8 667 316	0,68	
Total USD						**8 667 316**	**0,68**	
Total Treasury-Notes, fester Zins						**8 667 316**	**0,68**	
Total Nicht-Effekten						**789 510 417**	**61,49**	
Total Wertschriften						**1 216 448 077**	**94,74**	
(davon ausgeliehen							0,00)	
Bankguthaben auf Sicht						60 438 580	4,71	
Derivative Finanzinstrumente						3 642 178	0,28	
Sonstige Vermögenswerte						3 442 187	0,27	
Gesamtfondsvermögen						**1 283 971 022**	**100,00**	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-8 761 594		
Andere Verbindlichkeiten						-3 177 396		
Nettofondsvermögen						**1 272 032 032**		

Bewertungskategorie	**Verkehrswert per 30.09.2017**	**in % des Gesamt-fondsvermögens[3]**	**Verkehrswert Vorjahr**	**in %**
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	433 899 822	33,79	406 779 216	33,28
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	786 190 433	61,23	766 772 552	62,73
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**1 220 090 255**	**95,02**	**1 173 551 768**	**96,01**

[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 / Scheinlagen
[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					
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.17*	-70	USD	11 184 247	283 628	0.02
			11 184 247	283 628	0.02

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17*	312	JPY	44 922 290	1 976 246	0.15
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17*	167	GBP	15 890 074	2 168	0.00
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17*	1 201	USD	146 196 431	3 204 457	0.25
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17*	2 177	EUR	89 051 811	3 848 469	0.30
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17*	149	CHF	13 605 190	388 890	0.03
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17*	1 204	USD	63 451 201	-1 070 882	-0.08
			373 116 997	8 349 348	0.65
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
SHORT EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 07.12.17*	104	EUR	13 416 902	11 897	0.00
EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 07.12.17*	125	EUR	19 297 538	-110 100	-0.01
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17*	259	USD	31 404 365	-293 680	-0.02
EURO-BUND FUTURE 07.12.17*	23	EUR	4 236 113	-30 519	0.00
CANADA 10YR BOND FUTURE 18.12.17*	135	CAD	14 131 610	-279 917	-0.02
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.17*	556	AUD	53 628 239	-968 495	-0.08
			136 114 767	-1 670 814	-0.13

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 509 231 764

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
AUD	13 171 008	CHF	10 009 966	04.10.2017	12 065	0.00
CAD	12 569 402	CHF	9 653 301	04.10.2017	-69 951	-0.01
CAD	515 757	CHF	396 101	04.10.2017	-2 870	0.00
CHF	239 777	EUR	209 963	04.10.2017	389	0.00
GBP	195 582	CHF	242 522	04.10.2017	-11 357	0.00
GBP	37 458 148	CHF	46 448 104	04.10.2017	-2 175 158	-0.17
CHF	258 051	USD	269 364	04.10.2017	2 543	0.00
USD	203 696 771	CHF	195 141 507	04.10.2017	-1 922 887	-0.15
EUR	70 079 372	CHF	80 030 643	04.10.2017	-129 831	-0.01
GBP	839 312	CHF	1 041 292	04.10.2017	-48 192	0.00
EUR	774 634	CHF	884 531	04.10.2017	-1 536	0.00
USD	1 802 294	CHF	1 727 571	04.10.2017	-16 040	0.00
EUR	625 179 190	CHF	715 830 173	09.11.2017	1 058 908	0.08
USD	32 985 000	CHF	31 896 495	09.11.2017	66 280	0.01
CHF	12 399 118	EUR	10 997 000	09.11.2017	173 821	0.01
EUR	20 959 000	CHF	23 869 681	09.11.2017	-92 874	-0.01
USD	19 676 000	CHF	18 898 798	09.11.2017	-88 357	-0.01
CHF	8 812 034	EUR	7 751 000	09.11.2017	49 732	0.00
CHF	10 927 769	EUR	9 449 000	09.11.2017	-124 669	0.00
					-3 319 984	-0.26

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			
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.17	USD	70	0
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.09.17	USD	70	70
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.17	USD	0	70

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
S&P500 EMINI FUTURE 16.06.17	USD	0	1 358
FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.17	GBP	0	167
TOPIX INDEX FUTURE 08.06.17	JPY	45	286
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.17	EUR	0	2 079
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.17	USD	503	1 204
SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.17	CHF	0	149
TOPIX INDEX FUTURE 07.09.17	JPY	223	223
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.09.17	GBP	167	167
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.17	CHF	149	149
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.09.17	USD	1 204	1 204
S&P500 EMINI FUTURE 15.09.17	USD	1 358	1 358
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.17	EUR	2 177	2 177
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17	JPY	312	0
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17	GBP	167	0
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17	USD	1 358	157
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17	EUR	2 177	0
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17	CHF	149	0
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17	USD	1 204	0
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.17	USD	98	470
EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 08.06.17	EUR	43	155
SHORT EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 08.06.17	EUR	0	104
EURO-BUND FUTURE 08.06.17	EUR	0	23
CANADA 10YR BOND FUTURE 21.06.17	CAD	0	135
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.17	AUD	127	556
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.17	USD	470	470
EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 07.09.17	EUR	125	125
SHORT EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 07.09.17	EUR	104	104
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.09.17	AUD	556	556
EURO-BUND FUTURE 07.09.17	EUR	23	23
CANADA 10YR BOND FUTURE 20.09.17	CAD	135	135
SHORT EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 07.12.17	EUR	104	0
EURO BTP ITALY GOVERMENT FUTURE 07.12.17	EUR	125	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17	USD	470	211
EURO-BUND FUTURE 07.12.17	EUR	23	0
CANADA 10YR BOND FUTURE 18.12.17	CAD	135	0
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.17	AUD	556	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	204 309 113	USD	204 286 641	05.04.2017
CHF	688 879	EUR	644 776	02.05.2017
CHF	214 968	USD	214 882	02.05.2017
EUR	8 034 000	CHF	8 599 594	18.05.2017
USD	12 163 000	CHF	12 190 975	18.05.2017
CHF	3 905 659	EUR	3 610 000	18.05.2017
EUR	8 011 000	CHF	8 686 728	18.05.2017
CHF	2 015 400	USD	2 000 000	18.05.2017
CHF	3 289 500	EUR	3 000 000	18.05.2017
CHF	720 004 993	EUR	657 839 190	18.05.2017
CHF	33 232 388	USD	32 985 000	18.05.2017
CAD	13 421 195	CHF	9 743 787	06.06.2017
EUR	72 015 931	CHF	77 921 237	06.06.2017
GBP	39 451 989	CHF	50 537 998	06.06.2017
USD	205 265 109	CHF	203 212 458	06.06.2017
CHF	425 196	EUR	392 609	06.06.2017
USD	405 116	CHF	401 875	06.06.2017
EUR	611 025	CHF	663 084	06.06.2017
GBP	245 297	CHF	314 912	06.06.2017
USD	1 575 654	CHF	1 563 521	06.06.2017
CHF	200 810 895	USD	207 245 879	06.06.2017
CHF	9 637 089	CAD	13 421 195	06.06.2017
CHF	49 395 333	GBP	39 697 286	06.06.2017
CHF	78 624 197	EUR	72 234 346	06.06.2017
CHF	9 453 161	AUD	13 188 924	06.06.2017
CHF	890 004	GBP	715 264	07.06.2017
CHF	8 053 565	EUR	7 415 805	08.06.2017
USD	914 909	CHF	884 717	05.07.2017
GBP	146 520	CHF	182 124	05.07.2017
EUR	313 647	CHF	341 248	05.07.2017
USD	207 245 879	CHF	200 406 765	05.07.2017
CAD	13 421 195	CHF	9 622 997	05.07.2017
GBP	39 697 286	CHF	49 343 727	05.07.2017
EUR	72 234 346	CHF	78 590 969	05.07.2017
CHF	5 211 384	USD	5 389 228	05.07.2017
CHF	2 195 405	GBP	1 766 215	05.07.2017
CHF	2 272 832	EUR	2 089 000	05.07.2017
CHF	611 232	CAD	852 486	05.07.2017
AUD	13 188 924	CHF	9 430 080	05.07.2017
GBP	715 264	CHF	889 074	05.07.2017
CHF	76 973 632	EUR	70 458 993	05.07.2017
CHF	9 689 572	AUD	13 188 924	05.07.2017
CHF	48 267 041	GBP	38 792 856	05.07.2017
USD	202 771 560	CHF	193 849 611	03.08.2017
EUR	70 458 993	CHF	76 941 220	03.08.2017
AUD	13 188 924	CHF	9 667 481	03.08.2017
CAD	12 568 709	CHF	9 263 139	03.08.2017
GBP	38 792 856	CHF	48 219 520	03.08.2017
CHF	13 168	AUD	17 916	03.08.2017
EUR	918	CHF	1 004	03.08.2017
CHF	973 498	GBP	781 424	03.08.2017
CHF	679 022	EUR	620 565	03.08.2017
USD	128 446	CHF	123 309	03.08.2017
CHF	10 168 018	AUD	13 171 008	03.08.2017
CHF	9 744 520	CAD	12 568 709	03.08.2017
CHF	79 512 095	EUR	69 839 346	03.08.2017
CHF	48 346 740	GBP	38 011 432	03.08.2017
CHF	198 598 526	USD	202 900 006	03.08.2017
CHF	536	CAD	693	03.08.2017
CHF	273 510	EUR	240 026	03.08.2017
CHF	379 774	USD	393 100	03.08.2017
EUR	657 839 190	CHF	719 281 370	10.08.2017
USD	32 985 000	CHF	33 055 258	10.08.2017
CHF	11 400 522	EUR	10 420 000	10.08.2017
CHF	20 677 621	EUR	18 979 000	10.08.2017
EUR	22 427 000	CHF	24 445 430	10.08.2017
EUR	7 361 000	CHF	7 987 568	10.08.2017
EUR	6 629 000	CHF	7 245 497	10.08.2017
EUR	6 390 000	CHF	6 999 926	10.08.2017
CHF	10 208 606	EUR	9 019 000	10.08.2017
CHF	17 106 737	EUR	15 027 000	10.08.2017
CHF	11 389 965	EUR	10 018 000	10.08.2017
CHF	13 761 986	EUR	12 004 000	10.08.2017
CHF	716 611 647	EUR	625 179 190	10.08.2017
CHF	32 083 685	USD	32 985 000	10.08.2017
CAD	12 568 709	CHF	9 728 181	05.09.2017
AUD	13 171 008	CHF	10 141 676	05.09.2017
GBP	38 011 432	CHF	48 295 425	05.09.2017
USD	202 900 006	CHF	198 176 494	05.09.2017
EUR	69 839 346	CHF	79 477 176	05.09.2017
CAD	693	CHF	535	05.09.2017
CHF	703 777	GBP	553 284	05.09.2017
EUR	240 026	CHF	273 390	05.09.2017
USD	393 100	CHF	378 949	05.09.2017

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
USD	403 665	CHF	388 770	05.09.2017
AUD	13 171 008	CHF	10 009 966	04.10.2017
CAD	12 569 402	CHF	9 653 301	04.10.2017
CAD	515 757	CHF	396 101	04.10.2017
CHF	239 777	EUR	209 963	04.10.2017
GBP	195 582	CHF	242 522	04.10.2017
GBP	37 458 148	CHF	46 448 104	04.10.2017
CHF	258 051	USD	269 364	04.10.2017
USD	203 696 771	CHF	195 141 507	04.10.2017
EUR	70 079 372	CHF	80 030 643	04.10.2017
GBP	839 312	CHF	1 041 292	04.10.2017
EUR	774 634	CHF	884 531	04.10.2017
USD	1 802 294	CHF	1 727 571	04.10.2017
EUR	625 179 190	CHF	715 830 173	09.11.2017
USD	32 985 000	CHF	31 896 495	09.11.2017
CHF	12 399 118	EUR	10 997 000	09.11.2017
EUR	20 959 000	CHF	23 869 681	09.11.2017
USD	19 676 000	CHF	18 898 798	09.11.2017
CHF	8 812 034	EUR	7 751 000	09.11.2017
CHF	10 927 769	EUR	9 449 000	09.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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: 1,00%

Auflegungsdatum

1.9.2014

Umrechnungskurse

AUD	1	=	CHF	0.759227	HKD	1	=	CHF 0.123881
CAD	1	=	CHF	0.773678	JPY	1	=	CHF 0.008596
EUR	1	=	CHF	1.143897	USD	1	=	CHF 0.967600
GBP	1	=	CHF	1.298181				

FORTUNA INVEST – Risk Control 6

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		1 292 466 065.08	1 224 818 659.29	1 086 343 498.65
	CH0237262990			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		101.73	100.08	98.33
Anzahl Anteile im Umlauf		12 704 559,0000	12 237 786,0000	11 048 325,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Emittenten in % des Gesamtfondsvermögens	
Switzerland Government Bonds	3,97
Spain Letras del Tes	3,54
Italy, Republic	3,54
France, Republic	3,24
Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau	2,59
European Investment Bank	2,30
German Treasury Bill	2,22
Oesterreichische Kontrollbank AG	2,03
Netherlands Government	1,92
European Financial Stability	1,76
Übrige	59,27
Total	**86,38**

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
Verkehrswerte	**CHF**	**CHF**
Bankguthaben		
– auf Sicht	189 498 277.24[1]	217 747 962.74[2]
Geldmarktinstrumente	45 859 734.63	21 437 657.38
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 073 384 947.76	993 338 888.32
Derivative Finanzinstrumente	-23 576 776.57	4 238 919.45
Sonstige Vermögenswerte	10 530 589.90	11 060 388.83
Gesamtfondsvermögen	**1 295 696 772.96**	**1 247 823 816.72**
Aufgenommene Kredite	0.00	-19 952 773.69
Andere Verbindlichkeiten	-3 230 707.88	-3 052 383.74
Nettofondsvermögen	**1 292 466 065.08**	**1 224 818 659.29**

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
Ertrag	**CHF**	**CHF**
Erträge der Bankguthaben	87 786.22	43 978.45
Negativzinsen	-515 044.67	-926 023.86
Erträge der Geldmarktinstrumente	-31 503.81	0.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	9 262 176.75	20 048 643.30
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	36 884.60	333 506.10
Total Ertrag	**8 840 299.09**	**19 500 103.99**
Aufwand		
Passivzinsen	-32 046.64	-210 771.30
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-6 305 263.34	-11 616 628.44
Sonstige Aufwendungen	-70.82	-110.82
Total Aufwand	**-6 337 380.80**	**-11 827 510.56**
Nettoertrag	**2 502 918.29**	**7 672 593.43**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	24 321 158.78	38 966 376.00
Realisierter Erfolg	**26 824 077.07**	**46 638 969.43**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-3 551 506.29	-18 381 287.94
Gesamterfolg	**23 272 570.78**	**28 257 681.49**

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	**CHF**
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 224 818 659.29	1 086 343 498.65
Abgeführte Verrechnungssteuer	-2 736 865.59	-6 653 062.30
Saldo aus dem Anteilverkehr	47 111 700.60	116 870 541.45
Gesamterfolg	23 272 570.78	28 257 681.49
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	**1 292 466 065.08**	**1 224 818 659.29**

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	**Anzahl**
Bestand Anfang Rechnungsjahr	12 237 786,0000	11 048 325,0000
Ausgegebene Anteile	466 773,0000	1 189 461,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	**12 704 559,0000**	**12 237 786,0000**
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	466 773,0000	1 189 461,0000

[1] Zum 30. September 2017 wurden gegenüber EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 29 840 000 als Sicherheiten hinterlegt.
[2] Zum 31. März 2017 wurden von EFG Bank AG Bankguthaben in Höhe von CHF 2 200 000 als Sicherheiten erhalten.

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Notes, fester Zins								
CHF								
AT&T INC-REG-S 1.37500% 14-04.12.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 101 000	0,16	
BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV 3.00000% 14-31.03.20*	CHF	1 550 000			1 550 000	1 648 425	0,13	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.62500% 12-05.03.19*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 116 000	0,32	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.37500% 13-15.03.23*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 425 000	0,42	
CAISSE FRANCAISE DE FIN LOCAL 2.62500% 09-12.08.19*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 059 000	0,08	
SLOVAKIA, REPUBLIC OF 2.12500% 12-25.04.18*	CHF	7 950 000	2 050 000		10 000 000	10 158 000	0,78	
SOCIETE GENERALE SA 0.87500% 13-19.06.18*	CHF		7 000 000		7 000 000	7 067 200	0,55	
Total CHF						**31 574 625**	**2,44**	
EUR								
NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF 2.37500% 13-13.05.33*	EUR		5 000 000		5 000 000	6 529 763	0,50	
STATE GRID EUROPE DEVELOPMENT-REG-S 1.50000% 15-26.01.22*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 356 427	0,18	
STATE GRID EUROPE DEVELOPMENT-REG-S 2.45000% 15-26.01.27*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 415 006	0,19	
UNITYMEDIA KABELBW GMBH-REG-S 5.50000%12-15.09.22*	EUR	2 000 000		2 000 000				
Total EUR						**11 301 196**	**0,87**	
USD								
AIR LIQUIDE FINANCE SA-REG-S 3.50000% 16-27.09.46*	USD	2 000 000		2 000 000				
HSBC HOLDINGS PLC 2.65000% 16-05.01.22*	USD	5 000 000		5 000 000				
Total USD							**0,00**	
Total Notes, fester Zins						**42 875 821**	**3,31**	
Notes, variabler Zins								
CHF								
SWISS REINSURANCE CO-SUB 7.500%/VAR 13-01.09.45*	CHF	4 900 000		2 000 000	2 900 000	3 165 350	0,24	
Total CHF						**3 165 350**	**0,24**	
EUR								
BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.750%/VAR 04-06.05.19*	EUR	1 500 000			1 500 000	1 745 272	0,13	
Total EUR						**1 745 272**	**0,13**	
USD								
COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S 3M LIBOR+45BP 17-10.03.20*	USD	2 000 000			2 000 000	1 938 819	0,15	
MORGAN STANLEY 3M LIBOR+118BP 17-20.01.22*	USD	5 000 000			5 000 000	4 906 066	0,38	
Total USD						**6 844 885**	**0,53**	
Total Notes, variabler Zins						**11 755 506**	**0,91**	
Medium-Term Notes, fester Zins								
CHF								
ABN AMRO BANK NV 1.12500% 13-25.10.18*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 054 300	0,24	
ACHMEA BANK NV 0.50000% 17-27.10.23*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 042 000	0,23	
ACHMEA BANK NV 3.50000% 07-22.08.17*	CHF	5 000 000		5 000 000				
ACHMEA HYPOTHEKENBANK NV 1.50000% 13-19.06.19*	CHF	4 500 000			4 500 000	4 621 500	0,36	
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT 2.62500% 10-18.02.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 935 000	0,46	
AUCHAN HOLDING SA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24*	CHF	1 650 000			1 650 000	1 765 500	0,14	
BANCO SANTANDER SA 0.750000% 17-12.06.23*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 012 500	0,08	
BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 3.12500% 07-02.07.18*	CHF		12 000 000		12 000 000	12 349 200	0,95	
BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 2.12500% 10-09.11.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 213 500	0,09	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 1.12500% 14-22.05.20*	CHF	3 475 000			3 475 000	3 598 363	0,28	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT 0.55000% 15-08.12.23*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 039 000	0,16	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 14-08.09.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 111 000	0,16	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 0.75000% 14-27.09.21*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 057 000	0,16	
BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.87500% 09-27.12.17*	CHF	10 000 000			10 000 000	10 086 000	0,78	
CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 2.50000% 11-09.12.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 960 000	0,46	
CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 2.37500% 11-19.04.23*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 406 500	0,26	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.87500% 12-23.05.22*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 184 000	0,17	
CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 3.25000% 07-13.11.17*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 018 000	0,31	
CITIGROUP INC 3.12500% 06-27.09.21*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 685 250	0,13	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.50000% 15-26.02.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 014 000	0,16	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 15-15.09.23*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 096 000	0,32	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.00000% 15-27.01.25*	CHF	3 300 000			3 300 000	3 445 200	0,27	
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 1.00000% 15-14.04.23*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 059 000	0,16	
CREDIT SUISSE LONDON BRANCH 0.55000% 16-15.04.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 010 000	0,16	
DANSKE BANK AS 2.12500% 11-17.05.18*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 086 000	0,39	
DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.50000% 11-18.12.17*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 014 100	0,23	
DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.50000% 14-26.08.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 507 500	0,43	
DNB BANK ASA 1.75000% 12-18.04.18*	CHF	1 310 000			1 310 000	1 326 244	0,10	
ENGIE SA 1.12500% 12-09.10.20*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 551 000	0,12	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 10-24.08.22*	CHF	2 350 000			2 350 000	2 622 600	0,20	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.50000% 12-02.08.24*	CHF	9 350 000			9 350 000	10 439 275	0,81	
GENERAL ELECTRIC CO 4.50000% 08-09.10.18*	CHF		2 550 000		2 550 000	2 681 580	0,21	
GLENCORE FINANCE EUROPE SA 2.62500% 12-03.12.18*	CHF	3 800 000			3 800 000	3 914 760	0,30	
ILE DE FRANCE 3.25000% 07-27.11.18*	CHF		12 000 000		12 000 000	12 526 800	0,97	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 3.25000% 07-28.06.24*	CHF	6 100 000			6 100 000	7 243 750	0,56	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 2.25000% 09-07.11.17*	CHF	2 000 000	2 000 000		4 000 000	4 011 200	0,31	
JPMORGAN CHASE & CO 0.45000% 16-11.11.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 990 000	0,15	
KOREA GAS CORP 1.12500% 13-12.02.20*	CHF	3 350 000			3 350 000	3 427 050	0,26	
KOREA NATIONAL OIL CORP 1.62500% 13-29.11.18*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 018 300	0,08	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.50000% 05-25.08.25*	CHF	10 000 000	2 000 000		12 000 000	14 436 000	1,11	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
LAFARGEHOLCIM LTD 4.00000% 09-11.09.18*	CHF	4 000 000	2 000 000		6 000 000	6 247 200	0,48	
MACQUARIE BANK LTD 0.62500% 15-04.09.23*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 069 000	0,24	
MACQUARIE BANK LTD 3.00000% 12-09.08.17*	CHF	2 000 000		2 000 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 3.00000% 07-12.06.17*	CHF	5 000 000		5 000 000				
MUNICIPALITY FINANCE PLC 0.87500% 13-01.02.23*	CHF	7 000 000			7 000 000	7 430 500	0,57	
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 2.37500% 06-27.01.23*	CHF	10 000 000			10 000 000	11 400 000	0,88	
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 2.50000% 06-27.12.18*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 196 500	0,40	
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 1.37500% 12-13.09.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 116 500	0,09	
NIBC BANK NV 1.37500% 16-17.06.19*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 038 000	0,16	
NORDEA BANK AB 0.25000% 15-27.11.23*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 018 000	0,16	
NORDEA BANK AB 0.75000% 14-04.10.19*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 043 000	0,16	
NORDEA BANK AB 0.87500% 13-25.09.18*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 076 000	0,39	
NORDEA BANK AB 1.50000% 12-29.09.17*	CHF	2 000 000		2 000 000				
ONTARIO, PROVINCE OF 3.75000% 08-30.07.18*	CHF		10 000 000		10 000 000	10 370 000	0,80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.00000% 12-18.09.20*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 068 000	0,16	
POLAND, REPUBLIC OF 3.62500% 08-21.04.17*	CHF	10 000 000		10 000 000				
POLAND, REPUBLIC OF 2.25000% 12-15.05.18*	CHF	7 500 000	5 000 000		12 500 000	12 725 000	0,98	
POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 14-17.09.21*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 246 000	0,48	
QUEBEC, PROVINCE OF 3.87500% 09-11.12.18*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 271 000	0,41	
QUEBEC, PROVINCE OF 1.12500% 13-22.02.23*	CHF		2 500 000		2 500 000	2 670 000	0,21	
RABOBANK NEDERLAND NV 3.62500% 09-02.07.19*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 345 000	0,41	
RABOBANK NEDERLAND NV 2.00000% 10-16.09.21*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 250 500	0,25	
REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 2.62500% 06-06.11.19*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 187 500	0,25	
REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 3.25000% 07-09.10.17*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 000 600	0,08	
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 0.76000% 15-17.06.22*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 112 500	0,39	
SNCF RESEAU 2.00000% 10-12.11.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 309 000	0,18	
SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.25000% 13-17.07.23*	CHF		5 000 000		5 000 000	5 410 000	0,42	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.25000% 13-20.12.19*	CHF	1 700 000			1 700 000	1 756 100	0,14	
SWISS REINSURANCE 2.12500% 11-22.09.17*	CHF	11 600 000		11 600 000				
SWISSCOM AG 3.25000% 09-14.09.18*	CHF	6 800 000	2 000 000		8 800 000	9 119 440	0,70	
SYNGENTA FINANCE LTD REG-S 0.75000% 14-01.11.19*	CHF	2 000 000	1 500 000		3 500 000	3 491 250	0,27	
TELEFONICA EMISIONES SAU 2.59500% 13-23.10.20*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 078 000	0,08	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.37500% 17-31.05.23*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 988 000	0,23	
VINCI SA 2.12500% 11-15.12.17*	CHF	3 000 000	4 500 000		7 500 000	7 542 750	0,58	
ZURICH INSURANCE CO 2.25000% 11-27.07.17*	CHF	13 050 000		13 050 000				
Total CHF						**301 134 312**	**23,24**	
EUR								
ABN AMRO BANK NV 1.00000% 16-13.04.31*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 314 635	0,26	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 1.75000% 13-20.11.17*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 292 255	0,18	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 2.75000% 16-17.03.36*	EUR		1 500 000		1 500 000	1 866 067	0,14	
BA COVERED BOND ISSUER 4.25000% 07-05.04.17*	EUR	1 800 000		1 800 000				
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 3.50000% 17-10.02.27*	EUR	1 500 000		500 000	1 000 000	1 253 436	0,10	
BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 0.25000% 15-07.05.25*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 255 741	0,17	
BARCLAYS PLC-REG-S 1.50000% 14-01.04.22*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 550 118	0,27	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 5.37500% 07-29.06.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.00000% 15-13.03.45*	EUR		3 000 000	1 500 000	1 500 000	1 480 071	0,11	
BBVA SENIOR FINANCE SA 3.75000% 13-17.01.18*	EUR		4 000 000		4 000 000	4 628 435	0,36	
BELFIUS BANK SA/NV-REG-S 1.12500% 14-22.05.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
BMW FINANCE NV-REG-S 0.50000% 14-05.09.18*	EUR		4 270 000		4 270 000	4 914 918	0,38	
CHINA CONSTRUCT BK ASIA CORP LTD-REG-S 1.50000% 15-11.02.20*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 168 662	0,09	
CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.50000% 16-01.06.21*	EUR		4 500 000		4 500 000	5 147 535	0,40	
COMMERZBANK AG 1.50000% 13-28.02.18*	EUR	3 500 000			3 500 000	4 032 585	0,31	
CREDIT MUTUEL ARKEA 5.00000% 07-28.06.17*	EUR	10 000 000		10 000 000				
DEXIA CREDIT LOCAL DE FRANCE-REG-S 1.25000% 15-27.10.25*	EUR		7 000 000		7 000 000	8 294 258	0,64	
ENGIE SA-REG-S 1.50000% 12-20.07.17*	EUR	5 000 000	3 000 000	8 000 000				
EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.75000% 17-03.05.27*	EUR		20 000 000		20 000 000	22 866 495	1,76	
EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.25000% 14-13.11.26*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 885 766	0,38	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 2.00000% 13-30.04.20*	EUR	352 000			352 000	420 950	0,03	
GAS NATURAL CAPITAL MARKETS SA-REG-S 4.12500% 12-24.04.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC-REG-S 5.62500% 07-13.12.17*	EUR		6 000 000	6 000 000				
HSBC BANK PLC 3.12500% 10-15.11.17*	EUR	10 000 000			10 000 000	11 485 066	0,89	
ISRAEL, STATE OF-REG-S 1.50000% 17-18.01.27*	EUR		6 000 000		6 000 000	7 068 595	0,55	
JEFFERIES GROUP INC-REG-S 2.37500% 14-20.05.20*	EUR	880 000			880 000	1 058 320	0,08	
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.62500% 16-25.01.24*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 255 238	0,17	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.62500% 07-04.01.23*	EUR		3 000 000		3 000 000	4 278 974	0,33	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.62500% 17-22.02.27*	EUR		10 000 000		10 000 000	11 464 934	0,88	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 1.12500% 17-15.09.32*	EUR		3 000 000		3 000 000	3 430 832	0,26	
LANXESS AG-REG-S 1.00000% 16-07.10.26*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 352 899	0,26	
LINDE FINANCE BV 4.75000% 07-24.04.17*	EUR	10 000 000		10 000 000				
LITHUANIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.12500% 15-22.10.35*	EUR	2 850 000			2 850 000	3 587 094	0,28	
MEXICO, UNITED STATES OF 1.62500% 15-06.03.24*	EUR	5 000 000		3 000 000	2 000 000	2 341 259	0,18	
MORGAN STANLEY 5.50000% 07-02.10.17*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 721 829	0,44	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 3.12500% 12-03.04.17*	EUR	11 000 000		11 000 000				
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.25000% 16-27.05.36*	EUR	500 000			500 000	547 423	0,04	
NIBC BANK NV-REG-S 2.00000% 15-26.07.18*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 323 895	0,18	
NTPC LTD-REG-S 2.75000% 17-01.02.27*	EUR	3 334 000		1 334 000	2 000 000	2 376 983	0,18	
RABOBANK NEDERLAND NV 3.37500% 10-21.04.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
RCI BANQUE SA-REG-S 1.37500% 17-08.03.24*	EUR	1 500 000		1 500 000				
RENAULT SA 4.62500% 12-18.09.17*	EUR	3 000 000		3 000 000				
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.37500% 12-20.02.18*	EUR		5 000 000		5 000 000	5 817 058	0,45	
SANOFI-REG-S 1.00000% 12-14.11.17*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 727 319	0,44	
SANTANDER INTERNATIONAL DEBT SAU-REG-S 4.12500% 10-04.10.17*	EUR		6 000 000		6 000 000	6 864 753	0,53	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.37500% 09-14.05.18*	EUR		10 000 000		10 000 000	11 766 579	0,91	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 5.62500% 08-11.06.18*	EUR		5 000 000		5 000 000	5 952 381	0,46	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 3.87500% 12-12.04.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
SOCIETE GENERALE 3.12500% 10-21.09.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 1.62500% 13-20.11.18*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 831 986	0,45	
TELENOR ASA 4.87500% 07-29.05.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE IV BV 2.87500% 12-15.04.19*	EUR		3 000 000		3 000 000	3 562 918	0,27	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 1.25000% 13-01.08.17*	EUR	20 000 000		20 000 000				
UBS JERSEY BRANCH 4.75000% 07-07.06.17*	EUR	4 000 000		4 000 000				
WELLS FARGO & CO-REG-S 1.37500% 16-26.10.26*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 445 108	0,27	
Total EUR						**182 633 371**	**14,10**	
USD								
ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.37500% 16-22.06.26*	USD	3 000 000		3 000 000				
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 1.62500% 16-30.08.19*	USD	4 000 000		4 000 000				
SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 1.62500% 17-06.04.20*	USD		15 000 000	15 000 000				
Total USD							**0,00**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**483 767 683**	**37,34**	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
CHF								
KOREA EXPRESSWAY CORPORATION 3M LIBOR+47BP 14-15.03.18*	CHF	2 700 000			2 700 000	2 705 940	0,21	
Total CHF						**2 705 940**	**0,21**	
EUR								
BANQUE FEDER DU CREDIT MUT-REG-S 3M EURIBOR+27BP 16-19.01.18*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 435 053	0,27	
BMW US CAPITAL LLC-REG-S 3M EURIBOR+20BP 15-20.04.18*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 290 333	0,18	
CREDIT SUISSE LONDON-REG-S 3M EURIBOR+45BP 15-18.06.18*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 737 042	0,44	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 3M EURIBOR+50BP 12-04.01.22*	EUR	500 000			500 000	589 364	0,05	
FCE BANK PLC-REG-S 3M EURIBOR+118BP 16-11.08.18*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 307 263	0,18	
GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 6M EURIBOR+84 11-15.06.17*	EUR	5 000 000		5 000 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3M EURIBOR+46BP 17-31.12.18*	EUR		10 000 000		10 000 000	11 484 037	0,89	
JP MORGAN CHASE & CO-REG-S 1.638%/VAR 17-18.05.28*	EUR		3 584 000	2 000 000	1 584 000	1 833 730	0,14	
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMB-REG-S 3M EURIBOR+45BP 15-22.09.17*	EUR	6 800 000		6 800 000				
UBS AG-REG-S-SUB 4.750%/VAR 14-12.02.26*	EUR	1 850 000			1 850 000	2 339 596	0,18	
UNILEVER NV-REG-S 3M EURIBOR+18BP 15-03.06.18*	EUR		1 963 000		1 963 000	2 249 040	0,17	
VONOVIA FINANCE BV-REG-S 3M EURIBOR+95BP 15-15.12.17*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 436 632	0,27	
Total EUR						**35 702 089**	**2,76**	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						**38 408 029**	**2,96**	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
ABB LTD 1.50000% 12-23.11.18*	CHF	4 600 000			4 600 000	4 697 060	0,36	
ADECCO SA 1.87500% 12-18.12.17*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 015 300	0,23	
ADECCO SA 2.62500% 12-18.12.20*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 176 000	0,17	
AT&T INC-REG-S 1.87500% 14-04.12.30*	CHF	1 000 000		1 000 000				
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF 0.12500% 15-26.02.26*	CHF	2 500 000			2 500 000	2 512 500	0,19	
BASEL-STADT, CANTON OF 1.87500% 10-31.05.19*	CHF	6 000 000			6 000 000	6 243 000	0,48	
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.62500% 12-27.02.18*	CHF		7 500 000		7 500 000	7 539 000	0,58	
CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS 1.25000% 13-16.12.20*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 156 000	0,24	
CIF EUROMORTGAGE 2.00000% 10-30.01.19*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 550 400	0,12	
CREDIT SUISSE 2.37500% 10-21.06.17*	CHF	2 000 000		2 000 000				
ELECTRICITE DE FRANCE 2.25000% 10-29.09.17*	CHF	6 000 000		6 000 000				
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 2.12500% 09-10.11.17*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 015 000	0,39	
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.37500% 13-21.02.28*	CHF	10 000 000			10 000 000	11 270 000	0,87	
GENERAL ELECTRIC CO 2.50000% 06-08.02.18*	CHF	7 000 000			7 000 000	7 078 400	0,55	
GENEVA, CANTON OF 0.50000% 15-27.11.30*	CHF	12 000 000			12 000 000	12 024 000	0,93	
GENEVA, CANTON OF 2.50000% 10-06.04.22*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 607 500	0,43	
HEIDELBERGCEMENT FIN LUX SA 7.25000% 11-14.11.17*	CHF	2 750 000	1 000 000		3 750 000	3 780 750	0,29	
HSBC BANK PLC 2.37500% 11-04.04.18*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 522 950	0,12	
LITHUANIA, REPUBLIC OF 2.00000% 12-11.04.18*	CHF	3 000 000	7 000 000		10 000 000	10 132 000	0,78	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 0.20000% 16-07.11.31*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 775 000	0,37	
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.62500% 06-22.11.24*	CHF	15 000 000			15 000 000	17 865 000	1,38	
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 1.00000% 12-28.09.21*	CHF	5 000 000	3 000 000		8 000 000	8 444 000	0,65	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 3.00000% 06-27.06.17*	CHF	5 000 000		5 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 15-24.01.25*	CHF	10 000 000			10 000 000	10 311 000	0,80	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-15.10.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 096 500	0,39	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 17-06.05.25*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 010 000	0,39	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.87500% 14-10.06.21*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 172 400	0,32	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.25000% 14-16.11.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 189 200	0,17	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL 0.25000% 16-11.02.28*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 956 000	0,38	
SGS SA 0.25000% 15-08.05.23*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 007 500	0,23	
SLOVAKIA, REPUBLIC OF 1.37500% 13-16.10.19*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 108 000	0,24	
SLOVAKIA, REPUBLIC OF 2.12500% 13-16.10.23*	CHF	5 000 000	2 000 000		7 000 000	7 878 500	0,61	
SWISSCOM AG 2.62500% 10-31.08.22*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 390 000	0,26	
SWITZERLAND 1.25000% 12-11.06.24*	CHF	20 000 000			20 000 000	22 118 000	1,71	
SWITZERLAND 1.25000% 12-27.06.37*	CHF	6 000 000			6 000 000	7 008 000	0,54	
SWITZERLAND 1.50000% 12-30.04.42*	CHF	500 000			500 000	628 500	0,05	
SWITZERLAND 2.00000% 10-28.04.21*	CHF	15 000 000			15 000 000	16 420 500	1,27	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 230 000	0,40	
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.12500% 16-27.07.18*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 988 600	0,23	
TOTAL CAPITAL SA 3.12500% 06-28.06.18*	CHF		12 000 000		12 000 000	12 338 400	0,95	
UBS GROUP FUNDING SWISS AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 465 100	0,11	
ZUERCHER KANTONALBANK 2.12500% 10-05.02.18*	CHF		5 500 000		5 500 000	5 552 800	0,43	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.25000% 17-27.01.26*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 006 000	0,23	
ZUERICH, CANTON OF 0.50000% 12-03.12.20*	CHF	6 300 000			6 300 000	6 485 850	0,50	
ZUERICH, CANTON OF 0.01000% 17-07.09.26*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 967 500	0,38	
Total CHF						**255 732 210**	**19,74**	
EUR								
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.87500% 15-25.05.31*	EUR	500 000			500 000	536 493	0,04	
AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.75000% 10-28.06.17*	EUR	6 000 000		6 000 000				
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.75000% 16-20.10.26*	EUR	10 000 000			10 000 000	11 646 470	0,90	
BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 1.87500% 12-18.09.19*	EUR	100 000			100 000	119 132	0,01	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.80000% 17-22.06.27*	EUR		10 000 000	5 000 000	5 000 000	5 756 775	0,44	
CIF EUROMORTGAGE 3.50000% 10-17.06.20*	EUR	2 300 000			2 300 000	2 894 427	0,22	
EMIRATES TELECOM CORP-REG-S 2.75000% 14-18.06.26*	EUR	3 500 000			3 500 000	4 420 017	0,34	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.75000% 12-25.10.27*	EUR	11 000 000		5 000 000	6 000 000	8 173 737	0,63	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.25000% 13-25.05.24*	EUR	6 000 000	5 000 000	11 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.50000% 13-25.05.30*	EUR	4 000 000	3 000 000		7 000 000	9 380 205	0,72	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 16-25.05.26*	EUR	20 000 000		20 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 2.00000% 17-25.05.48*	EUR		4 000 000		4 000 000	4 745 524	0,37	
GERMANY, REPUBLIC OF 6.25000% 00-04.01.30*	EUR	4 000 000	5 000 000		9 000 000	17 150 099	1,32	
GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 10-04.07.42*	EUR	10 000 000		3 000 000	7 000 000	11 624 484	0,90	
IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26*	EUR	4 500 000			4 500 000	5 257 744	0,41	
MAPFRE SA-REG-S 1.62500% 16-19.05.26*	EUR	3 000 000		1 500 000	1 500 000	1 747 623	0,13	
MYLAN NV-REG-S 2.25000% 16-22.11.24*	EUR		3 000 000		3 000 000	3 591 710	0,28	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.50000% 12-15.01.33*	EUR		7 000 000		7 000 000	9 843 586	0,76	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.50000% 16-15.07.26*	EUR	13 000 000			13 000 000	14 971 034	1,16	
SA DE GESTION DES STOCKS DE SEC-REG-S 0.62500% 16-20.10.28*	EUR	2 100 000			2 100 000	2 295 622	0,18	
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 0.50000% 15-27.04.18*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 440 595	0,27	
SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35*	EUR	5 000 000		1 500 000	3 500 000	3 891 617	0,30	
SPAIN, KINGDOM OF 5.85000% 11-31.01.22*	EUR	4 000 000			4 000 000	5 693 952	0,44	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 15-30.07.30*	EUR	6 500 000			6 500 000	7 437 782	0,57	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 16-30.04.26*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 611 545	0,28	
Total EUR						**138 230 173**	**10,67**	
USD								
JAPAN INTERNATIONAL COOPERATION 2.75000% 17-27.04.27*	USD		5 000 000	5 000 000				
Total USD							**0,00**	
Total Anleihen, fester Zins						**393 962 383**	**30,41**	
Anleihen, Nullcoupon								
CHF								
BASEL-STADT, CANTON OF 0.00000% 16-04.09.26*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 950 000	0,38	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-14.06.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	4 997 000	0,39	
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.00000% 17-23.09.18*	CHF	3 500 000			3 500 000	3 518 900	0,27	
Total CHF						**13 465 900**	**1,04**	
EUR								
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 16-15.09.23*	EUR		7 000 000		7 000 000	7 985 818	0,62	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 17-25.02.20*	EUR		17 000 000		17 000 000	19 673 571	1,52	
ITALY, REPUBLIC OF 0.00000% 15-30.08.17*	EUR	40 000 000		40 000 000				
ITALY, REPUBLIC OF 0.00000% 16-28.03.18*	EUR		40 000 000		40 000 000	45 835 942	3,54	
Total EUR						**73 495 330**	**5,67**	
Total Anleihen, Nullcoupon						**86 961 230**	**6,71**	
Anleihen, variabler Zins								
CHF								
DANSKE BANK AS-SUB 3.125%/VAR 13-18.12.25*	CHF	1 400 000			1 400 000	1 514 800	0,12	
SCOR SE-SUB 3.375%/VAR 14-PRP*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 062 000	0,08	
Total CHF						**2 576 800**	**0,20**	
EUR								
ATRADIUS FINANCE BV-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-23.09.44*	EUR	1 400 000		1 400 000				
COCA-COLA CO/THE 3M EURIBOR+23BP 15-09.09.19*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 447 373	0,27	
FRANCE, REPUBLIC OF 1.850%/CPTFEMU LINKED 10-25.07.27*	EUR		5 000 000	5 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF 0.250%/CPTFEMU LINKED 13-25.07.24*	EUR	15 000 000		15 000 000				
VIENNA INSR-REG-S-SUB 5.500%/3M EURIBOR+439.7BP 13-09.10.43*	EUR	3 400 000		1 400 000	2 000 000	2 731 076	0,21	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-15.06.27*	EUR	1 434 000			1 434 000	1 709 390	0,13	
Total EUR						**7 887 839**	**0,61**	
Total Anleihen, variabler Zins						**10 464 639**	**0,81**	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						**1 068 195 293**	**82,44**	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins								
USD								
INTESA SANPAOLO SPA 3.87500% 13-15.01.19*	USD	2 000 000			2 000 000	1 975 524	0,15	
Total USD						**1 975 524**	**0,15**	
Total Notes, fester Zins						**1 975 524**	**0,15**	
Medium-Term Notes, fester Zins								
EUR								
CORES-REG-S 1.50000% 15-27.11.22*	EUR	2 700 000			2 700 000	3 214 131	0,25	
Total EUR						**3 214 131**	**0,25**	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						**3 214 131**	**0,25**	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						**5 189 655**	**0,40**	

Titel		31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe[1]	Verkäufe[2]	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert[3] in CHF	in %[3]	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Nicht-Effekten								
Treasury-Bills, Nullcoupon								
EUR								
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 15.07.16-14.07.17**	EUR	20 000 000		20 000 000				
SPAIN, KINGDOM OF TB 0.00000% 12.05.17-11.05.18**	EUR		40 000 000		40 000 000	45 859 734	3,54	
Total EUR						**45 859 734**	**3,54**	
Total Treasury-Bills, Nullcoupon						**45 859 734**	**3,54**	
Total Nicht-Effekten						**45 859 734**	**3,54**	
Total Wertschriften						**1 119 244 682**	**86,38**	
(davon ausgeliehen							0,00)	
Bankguthaben auf Sicht						189 498 277	14,63	
Derivative Finanzinstrumente						-23 576 777	-1,82	
Sonstige Vermögenswerte						10 530 591	0,81	
Gesamtfondsvermögen						**1 295 696 773**	**100,00**	
Andere Verbindlichkeiten						-3 230 708		
Nettofondsvermögen						**1 292 466 065**		

Bewertungskategorie	**Verkehrswert per 30.09.2017**	**in % des Gesamt-fondsvermögens[3]**	**Verkehrswert Vorjahr**	**in %**
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 078 606 901	83,24	995 451 174	79,77
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	17 061 004	1,32	23 564 291	1,89
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–	–	–
Total	**1 095 667 905**	**84,56**	**1 019 015 465**	**81,66**

[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 / Scheinlagen
[2] «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen
[3] Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)
** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.17*	-200	EUR	25 653 028	1 144	0.00
EURO-BUND FUTURE 07.12.17*	-128	EUR	23 574 888	184 488	0.01
			49 227 916	185 632	0.01

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Swaps auf Indizes					
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML FIX@-0.329% 17-20.12.17**	14 000 000	EUR	15 175 934	380 692	0.03
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 17-20.12.17	14 000 000	EUR			
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML FIX@-0.329% 17-20.03.18**	14 000 000	EUR	15 414 155	234 190	0.02
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 17-20.03.18	14 000 000	EUR			
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML FIX@-0.329% 17-20.09.18**	25 000 000	EUR	28 696 422	258 935	0.02
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 17-20.09.18	25 000 000	EUR			
			59 286 511	873 817	0.07

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17*	449	JPY	64 647 783	3 705 186	0.29
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17*	366	GBP	34 824 952	-161 546	-0.01
NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 15.12.17*	151	USD	17 481 774	-24 692	0.00
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17*	477	USD	58 064 694	700 395	0.05
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17*	1 391	EUR	56 899 894	1 257 017	0.10

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17*	676	CHF	61 725 560	757 120	0.06
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17*	1 074	USD	56 600 159	-930 086	-0.07
CHF CURRENCY FUTURE 18.12.17*	260	USD	32 500 000	-535 642	-0.04
JAPANESE YEN CROSS CURRENCY FUTURE 18.12.17*	81	JPY	20 251 875	268 569	0.01
			402 996 691	5 036 321	0.39

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
GS/ITRX EUROPE S27 5Y CDI PAY 1.00000% 17-20.06.22**	20 000 000	EUR	22 322 784	-555 151	-0.04
			22 322 784	-555 151	-0.04

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 425 319 475

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	145 000 000	CHF	154 718 625	20.12.2017	-10 973 186	-0.85
CHF	21 796 000	EUR	20 000 000	20.12.2017	1 058 043	0.08
EUR	125 000 000	CHF	132 225 000	21.03.2018	-10 459 674	-0.81
EUR	108 000 000	CHF	114 161 400	20.06.2018	-9 002 312	0.69
EUR	110 000 000	CHF	125 598 000	19.09.2018	259 734	0.02
					-29 117 396	-2.25

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 Indices/Commodities/Währungen			
EUR/CHF CURRENCY FUTURE 19.06.17	CHF	97	0
EUR/CHF CURRENCY FUTURE 18.09.17	CHF	52	52
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.17	EUR	400	0
EURO-BUND FUTURE 07.09.17	EUR	128	128
EURO-SCHATZ FUTURE 07.12.17	EUR	0	200
EURO-BUND FUTURE 07.12.17	EUR	0	128

Instrument	Währung	Nominal
Swaps auf Indizes		
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML FIX@-0.329% 17-20.12.17	EUR	14 000 000
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 17-20.12.17	EUR	14 000 000
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML FIX@-0.329% 17-20.03.18	EUR	14 000 000
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 17-20.03.18	EUR	14 000 000
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR HY INDEX SWAP PAYER 3ML FIX@-0.329% 17-20.09.18	EUR	25 000 000
GOLDMAN SACHS/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 17-20.09.18	EUR	25 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
FTSE/MIB INDEX FUTURE 16.06.17	EUR	0	117
S&P500 EMINI FUTURE 16.06.17	USD	0	466
NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 16.06.17	USD	0	275
FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.17	GBP	0	361
TOPIX INDEX FUTURE 08.06.17	JPY	5	444
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.17	EUR	213	1 507
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 16.06.17	USD	135	1 208
SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.17	CHF	0	686
CHF CURRENCY FUTURE 19.06.17	USD	124	453
JAPANESE YEN CROSS CURRENCY FUTURE 19.06.17	JPY	0	63
TOPIX INDEX FUTURE 07.09.17	JPY	457	457
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.09.17	GBP	381	381
NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 15.09.17	USD	274	274
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.17	CHF	695	695
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.09.17	USD	1 141	1 141
S&P500 EMINI FUTURE 15.09.17	USD	495	495
CHF CURRENCY FUTURE 18.09.17	USD	512	512
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.17	EUR	1 458	1 458
JAPANESE YEN CROSS CURRENCY FUTURE 18.09.17	JPY	81	81
TOPIX INDEX FUTURE 07.12.17	JPY	457	8

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.12.17	GBP	381	15
NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 15.12.17	USD	274	123
S&P500 EMINI FUTURE 15.12.17	USD	495	18
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.12.17	EUR	1 458	67
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.17	CHF	695	19
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 15.12.17	USD	1 122	48
CHF CURRENCY FUTURE 18.12.17	USD	260	0
JAPANESE YEN CROSS CURRENCY FUTURE 18.12.17	JPY	81	0
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.17	USD	100	100

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
GS/ITRX EUROPE S27 5Y CDI PAY 1.00000% 17-20.06.22	EUR	20 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	108 000 000	CHF	116 542 800	21.06.2017
CHF	114 912 000	EUR	108 000 000	21.06.2017
EUR	110 000 000	CHF	119 669 000	20.09.2017
CHF	21 796 000	EUR	20 000 000	20.12.2017
EUR	110 000 000	CHF	125 598 000	19.09.2018

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

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 SFAMA 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: 1,00%

Auflegungsdatum

1.9.2014

Umrechnungskurse

EUR	1	=	CHF	1.143897	JPY	1	=	CHF	0.008596
GBP	1	=	CHF	1.298181	USD	1	=	CHF	0.967600

Vertriebs- und Zahlstellen

Vertriebsstellen

Fortuna Investment AG 8134 Adliswil 1	Soodmattenstrasse 10	058/472 53 05
GENERALI Versicherungen 8134 Adliswil 1	Soodmattenstrasse 10	058/472 44 44

Agenturen

5001 Aarau	Rain 35	058/473 90 30
8134 Adliswil	Soodmattenstrasse 4	058/472 75 00
6340 Baar	Zugerstrasse 76a	058/473 09 99
4051 Basel	Schützengraben 21	058/473 37 00
6501 Bellinzona	Via Lugano 22	058/471 60 60
3001 Bern	Monbijoustrasse 29	058/473 32 22
2502 Bienne	Rue de la Gare 14	058/473 74 52
7007 Chur	Ringstrasse 18	058/473 84 71
2800 Delémont	Rue des Moulins 9	058/471 49 49
1701 Fribourg	Route d'Agy 14-16	058/471 28 18
1215 Genève 15	I.C.C. Rte de Pré-Bois 20	058/471 07 00
1211 Genève 26	Route des Acacias 47	058/471 37 37
1211 Genève 3	Rue du Rhône 67	058/471 94 94
1005 Lausanne	Place de la Riponne 3	058/471 34 84
1052 Le Mont-sur-Lausanne	Rue du Village 10	058/471 25 25
6904 Lugano	Via Trevano 78	058/471 17 17
6002 Luzern	Nidfeldstrasse 12	058/473 18 18
1870 Monthey 1	Rue du Coppet 3	058/471 36 00
1820 Montreux 2	Avenue du Casino 50	058/471 47 00
2001 Neuchâtel	Faubourg de 'Hôpital 1	058/471 96 66
1260 Nyon 1	Avenue Perdtemps 23	058/471 44 44
4600 Olten	Ziegelfeldstrasse 36	058/473 38 38
8640 Rapperswil	Alte Jonastrasse 24	058/473 89 50
9494 Schaan	Zollstrasse 13	00423 239 72 72
1951 Sion	Avenue de la Gare 32	058/471 78 10
9001 St. Gallen	Bahnhofstrasse 11	058/473 36 36
3601 Thun	Burgstrasse 20	058/473 06 15
8400 Winterthur	Bahnhofplatz 8	058/473 16 66
1400 Yverdon-les-Bains	Rue du Milieu 7	058/471 09 61
8008 Zürich	Mühlebachstrasse 7	058/473 91 20

Zahlstellen

EFG Bank AG, 6900 Lugano mit sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz	Via Magatti 2	091/809 31 11