

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD (EX CHF) GOVT. (II)

Jahresbericht per 30.09.2024

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
DA USD	11498197	USD
FA USD	11498196	USD
GT USD	19231024	USD
NT USD	14054915	USD
NTH1 CHF	52089276	CHF

Rechnungswährung: USD

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Januar 2025

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II), bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigelegte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilagen

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	48
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	48
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	49
7	Pauschale Verwaltungskommission	49
8	Benchmark	49
9	TER	49
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	50
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	50
12	Fussnoten	50
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	51

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidiert					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		649'368'632.69	252'294'531.63	221'849'609.05	238'263'696.21
Klasse DA USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'670'617.68	23'507'203.96	19'652'885.58	24'621'243.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		353'590.701	352'144.091	292'006.757	279'949.563
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		72.5998	66.7545	67.3028	87.9489
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		61.2416	61.0670	66.2428	82.0431
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.35	1.25	1.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse FA USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'183'128.46	582'050.26	200'977.66	289'399.29
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'294.858	8'718.358	2'990.000	3'287.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		72.6075	66.7615	67.2166	88.0436
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.35	1.15	1.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.19 %
Klasse GT USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		28'977'407.19	24'941'568.84	21'226'238.64	24'807'293.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		323'159.251	306'470.251	261'812.251	236'668.636
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.6691	81.3833	81.0743	104.8187
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		75.6404	74.4495	79.7974	97.7801
Thesaurierung je Anteil		2.00	1.63	1.45	1.76
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		116'580'789.19	81'608'919.94	85'803'555.54	136'166'152.20
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'334'987.348	1'030'628.695	1'088'673.520	1'337'494.253
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.3273	79.1836	78.8148	101.8069
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		73.6649	72.4372	77.5734	94.9706
Thesaurierung je Anteil		2.06	1.70	1.54	1.86
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF 14)					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		476'956'690.17	121'654'788.63	94'965'951.63	52'379'607.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'887'410.639	1'406'068.638	1'127'026.911	502'664.485
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.3211	79.1496	82.9352	97.2066
Thesaurierung je Anteil (in USD)		2.27	1.85	1.61	1.92
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DA USD	10.89 %	4.96 %	-18.31 %	-7.10 %
Klasse FA USD	10.89 %	4.97 %	-18.31 %	-7.10 %
Klasse GT USD	10.92 %	5.02 %	-18.28 %	-7.06 %
Klasse NT USD	11.08 %	5.16 %	-18.17 %	-6.93 %
Klasse NTH1 CHF	4.73 %	1.76 %	-15.16 %	-3.36 %
Benchmark Hedge	4.81 %	1.89 %	-15.21 %	-
Benchmark	11.02 %	5.19 %	-18.26 %	-6.97 %
Tracking Error 33)	0.12 %	0.08 %	0.08 %	1.30 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DA USD	-0.13 %
Klasse FA USD	-0.13 %
Klasse GT USD	-0.10 %
Klasse NT USD	0.06 %
Klasse NTH1 CHF	-0.08 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	4'410'462.17	924'979.87
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	577'937'432.16	234'146'395.75
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	62'329'960.68	15'455'531.96
Sonstige Vermögenswerte	4'698'279.42	1'776'769.73
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	649'376'134.43	252'303'677.31
Andere Verbindlichkeiten	-7'501.74	-9'145.68
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	649'368'632.69	252'294'531.63

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse DA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		352'144.091	292'006.757
Ausgegebene Anteile		21'460.154	90'807.977
Zurückgenommene Anteile		-20'013.544	-30'670.643
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		353'590.701	352'144.091
Klasse FA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'718.358	2'990.000
Ausgegebene Anteile		8'277.500	5'743.358
Zurückgenommene Anteile		-701.000	-15.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		16'294.858	8'718.358
Klasse GT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		306'470.251	261'812.251
Ausgegebene Anteile		30'234.000	44'658.000
Zurückgenommene Anteile		-13'545.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		323'159.251	306'470.251
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'030'628.695	1'088'673.520
Ausgegebene Anteile		562'306.653	86'547.101
Zurückgenommene Anteile		-257'948.000	-144'591.926
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'334'987.348	1'030'628.695
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'406'068.638	1'127'026.911
Ausgegebene Anteile		3'499'176.768	640'456.932
Zurückgenommene Anteile		-17'834.767	-361'415.205
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'887'410.639	1'406'068.638

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		252'294'531.63	221'849'609.05
Ausbezahlte Ausschüttung		-499'340.60	-443'450.08
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'831'886.54	-1'318'980.00
Saldo aus dem Anteilverkehr		337'866'572.95	30'686'126.40
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		61'538'755.25	1'521'226.26
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		649'368'632.69	252'294'531.63

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		33'488.07	23'126.74
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-363.93	-932.00
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		8'561'438.10	4'827'140.10
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'174'967.46	353'735.32
Sonstige Erträge		-7.88	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		5'818'682.97	929'919.49
Total Ertrag		15'588'204.79	6'132'989.65
Aufwand			
Passivzinsen		2'501.71	-2'839.09
Reglementarische Vergütungen		-83'242.23	-76'380.81
Sonstige Aufwendungen		-10.83	-116.22
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-366'671.44	-700'913.16
Total Aufwand		-447'422.79	-780'249.28
Nettoertrag / Verlust		15'140'782.00	5'352'740.37
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		7'465'227.45	-8'790'030.63
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		441'322.52	94'480.93
Realisierter Erfolg		23'047'331.97	-3'342'809.33
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		38'491'423.28	4'864'035.59
Gesamterfolg		61'538'755.25	1'521'226.26

Verwendung des Erfolges

Klasse DA USD		30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag		565'925.69	466'889.59
Vortrag des Vorjahres		1'123.49	9'628.42
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		567'049.18	476'518.01
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		565'745.12	475'394.52
Vortrag auf neue Rechnung		1'304.06	1'123.49
Total		567'049.18	476'518.01
Klasse FA USD		30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag		26'093.19	11'687.81
Vortrag des Vorjahres		12.25	94.22
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		26'105.44	11'782.03
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		26'071.77	11'769.78
Vortrag auf neue Rechnung		33.67	12.25
Total		26'105.44	11'782.03
Klasse GT USD		30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag		647'632.75	501'977.66
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		647'632.75	501'977.66
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		226'671.46	175'692.18
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		420'961.29	326'285.48
Total		647'632.75	501'977.66
Klasse NT USD		30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag		2'759'234.13	1'759'877.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		2'759'234.13	1'759'877.73
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		965'731.95	615'957.51
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		1'793'502.18	1'143'920.52
Total		2'759'234.13	1'759'877.73
Klasse NTH1 CHF		30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag		11'141'896.24	2'612'307.58
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		11'141'896.24	2'612'307.58
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		3'899'663.68	914'307.65
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		7'242'232.56	1'697'999.93
Total		11'141'896.24	2'612'307.58

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							577'937'432.16	89.00	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							577'937'432.16	89.00	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	130	90	0	220 EUR	110.95%	272'420.71	0.04	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	180	175	0	355 EUR	113.69%	450'439.78	0.07	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	100	140	0	240 EUR	103.54%	277'333.10	0.04	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	45	55	0	100 EUR	116.57%	130'097.54	0.02	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	100	80	0	180 EUR	101.91%	204'725.34	0.03	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	95	130	0	225 EUR	97.95%	245'962.70	0.04	a)
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	170	150	30	290 EUR	98.61%	319'154.71	0.05	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	150	190	0	340 EUR	97.18%	368'755.16	0.06	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	110	130	0	240 EUR	75.41%	201'983.88	0.03	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	55	0	0	55 EUR	61.11%	37'510.88	0.01	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	178	160	20	318 EUR	95.94%	340'493.74	0.05	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	67	65	0	132 EUR	78.13%	115'099.66	0.02	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	110	185	0	295 EUR	95.29%	313'726.82	0.05	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	130	195	0	325 EUR	92.78%	336'527.09	0.05	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	168	140	0	308 EUR	88.22%	303'249.48	0.05	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	100	105	0	205 EUR	59.46%	136'038.26	0.02	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	42	75	0	117 EUR	46.33%	60'496.53	0.01	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	40	110	0	150 EUR	62.69%	104'947.43	0.02	a)
AT0000A2NWX3	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	190	140	0	330 EUR	85.74%	315'776.43	0.05	a)
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	35	75	0	110 EUR	46.17%	56'680.65	0.01	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	100	50	0	150 EUR	74.04%	123'948.13	0.02	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	95	155	0	250 EUR	91.42%	255'058.48	0.04	a)
AT0000A2W5C8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	100	190	0	290 EUR	89.27%	288'925.47	0.04	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	40	100	0	140 EUR	79.79%	124'669.09	0.02	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	50	40	0	90 EUR	99.64%	100'082.59	0.02	a)
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	108	270	0	378 EUR	102.34%	431'737.24	0.07	a)
AT0000A33SH3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	45	80	0	125 EUR	102.76%	143'356.18	0.02	a)
AT0000A33SK7	3.1500 % RAGB 3.15 10/20/53	0	105	0	105 EUR	101.54%	118'989.53	0.02	a)
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	0	160	0	160 EUR	105.81%	188'940.43	0.03	a)
AT0000A39UW5	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/34	0	250	0	250 EUR	102.14%	284'985.27	0.04	a)
AT0000A3D3Q8	3.2000 % RAGB 3.2 07/15/39	0	100	0	100 EUR	103.28%	115'259.70	0.02	a)
AT							6'767'372.00	1.04	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	200	350	0	550 AUD	94.11%	359'073.21	0.06	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	175	120	0	295 AUD	81.24%	166'270.92	0.03	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	283	320	0	603 AUD	86.56%	362'107.53	0.06	a)
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	290	365	0	655 AUD	82.78%	376'143.86	0.06	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	105	0	105	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	261	205	0	466 AUD	84.98%	274'713.55	0.04	a)
AU0000095457	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/25 161	245	130	0	375 AUD	96.10%	249'997.15	0.04	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	222	200	0	422 AUD	56.63%	165'791.40	0.03	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	385	240	0	625 AUD	82.52%	357'801.56	0.06	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	315	255	0	570 AUD	94.20%	372'498.17	0.06	a)
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	310	240	0	550 AUD	85.07%	324'576.14	0.05	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	250	340	0	590 AUD	92.71%	379'477.71	0.06	a)
AU0000249302	3.7500 % ACGB 3 3/4 05/21/34 167	150	350	0	500 AUD	98.28%	340'905.28	0.05	a)
AU0000274706	3.5000 % ACGB 3 1/2 12/21/34 168	175	300	0	475 AUD	95.84%	315'829.34	0.05	a)
AU0000300535	4.7500 % ACGB 4 3/4 06/21/54 169	0	200	0	200 AUD	102.89%	142'755.71	0.02	a)
AU0000345241	4.2500 % ACGB 4 1/4 12/21/35 171	0	270	0	270 AUD	101.95%	190'955.73	0.03	a)
AU0000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	250	320	0	570 AUD	104.20%	412'030.06	0.06	a)
AU0000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	213	200	0	413 AUD	100.92%	289'146.13	0.04	a)
AU0000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	113	240	0	353 AUD	88.98%	217'904.01	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	100	145	0	245 AUD	89.40%	151'955.46	0.02	a)
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	220	220	0	440 AUD	97.73%	298'320.83	0.05	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	164	235	0	399 AUD	95.70%	264'911.89	0.04	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	169	145	0	314 AUD	78.50%	171'004.62	0.03	a)
AU000XCLWAU3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	135	250	0	385 AUD	97.00%	259'078.27	0.04	a)
AU000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	170	260	0	430 AUD	95.95%	286'218.91	0.04	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	240	255	0	495 AUD	102.94%	353'492.09	0.05	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	245	240	0	485 AUD	98.63%	331'845.67	0.05	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	232	0	232	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	170	130	0	300 AUD	96.65%	201'154.89	0.03	a)
AU3TB0000200	4.2500 % ACGB 4 1/4 06/21/34 170	0	150	0	150 AUD	102.26%	106'409.11	0.02	a)
AU							7'722'369.20	1.19	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	240	220	30	430 EUR	110.84%	531'940.36	0.08	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	303	120	0	423 EUR	119.63%	564'772.65	0.09	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	200	225	20	405 EUR	114.05%	515'504.68	0.08	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	90	130	0	220 EUR	103.20%	253'387.20	0.04	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	100	120	0	220 EUR	109.61%	269'125.69	0.04	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	100	105	0	205 EUR	107.35%	245'605.57	0.04	a)
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	100	130	0	230 EUR	102.47%	263'030.96	0.04	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	245	170	415	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	180	200	0	380 EUR	91.02%	386'013.71	0.06	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	110	110	0	220 EUR	87.47%	214'765.30	0.03	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	200	180	20	360 EUR	97.95%	393'540.32	0.06	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	125	130	0	255 EUR	73.24%	208'435.08	0.03	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	110	80	0	190 EUR	74.43%	157'827.95	0.02	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	200	230	20	410 EUR	96.40%	441'106.23	0.07	a)
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	69	115	0	184 EUR	77.48%	159'107.16	0.02	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	40	90	0	130 EUR	84.16%	122'104.42	0.02	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	180	190	0	370 EUR	94.97%	392'174.73	0.06	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	115	150	0	265 EUR	89.98%	266'117.94	0.04	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	200	250	0	450 EUR	93.80%	471'083.24	0.07	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	120	125	0	245 EUR	71.97%	196'785.84	0.03	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	150	185	0	335 EUR	87.97%	328'898.35	0.05	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	102	60	0	162 EUR	66.38%	120'014.73	0.02	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	150	130	30	250 EUR	93.54%	260'987.48	0.04	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	150	160	0	310 EUR	83.98%	290'549.32	0.04	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	70	80	0	150 EUR	42.37%	70'930.34	0.01	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	160	170	0	330 EUR	84.49%	311'172.74	0.05	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	120	80	0	200 EUR	64.00%	142'853.95	0.02	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	58	100	0	158 EUR	96.48%	170'128.35	0.03	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	110	270	0	380 EUR	102.79%	435'930.00	0.07	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	70	170	0	240 EUR	97.82%	262'012.01	0.04	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	40	65	0	105 EUR	103.14%	120'864.49	0.02	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	0	325	0	325 EUR	100.81%	365'653.11	0.06	a)
BE0000361700	3.5000 % BGB 3 1/2 06/22/55 101	0	195	0	195 EUR	101.03%	219'870.65	0.03	a)
BE0000362716	2.7000 % BGB 2.7 10/22/29 102	0	180	0	180 EUR	101.68%	204'263.30	0.03	a)
BE							9'356'557.85	1.44	
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	70	80	0	150 CAD	92.84%	103'078.57	0.02	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	120	110	0	230 CAD	93.53%	159'235.35	0.02	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	85	60	0	145 CAD	97.73%	104'892.22	0.02	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	100	50	0	150 CAD	95.72%	106'285.21	0.02	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	100	50	0	150 CAD	97.64%	108'413.71	0.02	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	402	460	0	862 CAD	79.15%	505'000.11	0.08	a)
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	88	50	0	138 CAD	98.33%	100'442.39	0.02	a)
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	346	345	0	691 CAD	92.10%	471'094.28	0.07	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 03/01/25	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	280	230	510	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	335	280	0	615 CAD	87.20%	396'983.31	0.06	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	180	250	50	380 CAD	96.20%	270'594.77	0.04	a)
CA135087L930	1.0000 % CAN 1 09/01/26	180	240	0	420 CAD	96.59%	300'300.24	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
CA135087M276	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/31	392	455	50	797 CAD	92.03%	542'929.89	0.08	a)
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	355	325	0	680 CAD	73.56%	370'243.76	0.06	a)
CA135087M847	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/27	175	230	0	405 CAD	96.47%	289'206.49	0.04	a)
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	370	300	0	670 CAD	91.34%	452'998.26	0.07	a)
CA135087N340	1.5000 % CAN 1 1/2 04/01/25	150	0	150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	290	200	0	490 CAD	94.10%	341'311.60	0.05	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	50	50	0	100 CAD	97.82%	72'406.90	0.01	a)
CA135087N837	2.7500 % CAN 2 3/4 09/01/27	210	140	0	350 CAD	100.00%	259'071.77	0.04	a)
CA135087P246	3.0000 % CAN 3 10/01/25	130	100	0	230 CAD	99.75%	169'818.13	0.03	a)
CA135087P329	2.5000 % CAN 2 1/2 12/01/32	80	370	0	450 CAD	97.25%	323'935.38	0.05	a)
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	180	0	180	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P576	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/28	160	195	0	355 CAD	102.52%	269'402.68	0.04	a)
CA135087P659	3.7500 % CAN 3 3/4 02/01/25	150	0	150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P816	3.0000 % CAN 3 04/01/26	150	50	0	200 CAD	99.94%	147'947.74	0.02	a)
CA135087P998	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/55	90	415	0	505 CAD	92.26%	344'881.79	0.05	a)
CA135087Q236	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/33	150	280	0	430 CAD	98.87%	314'697.81	0.05	a)
CA135087Q319	3.7500 % CAN 3 3/4 05/01/25	165	0	165	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087Q491	3.2500 % CAN 3 1/4 09/01/28	155	270	0	425 CAD	101.96%	320'772.05	0.05	a)
CA135087Q640	3.5000 % CAN 3 1/2 08/01/25	250	100	350	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	50	415	0	465 CAD	102.75%	353'657.47	0.05	a)
CA135087Q806	4.5000 % CAN 4 1/2 11/01/25	0	460	50	410 CAD	101.34%	307'544.77	0.05	a)
CA135087Q988	4.0000 % CAN 4 03/01/29	0	575	0	575 CAD	105.27%	448'048.41	0.07	a)
CA135087R226	4.5000 % CAN 4 1/2 02/01/26	0	470	0	470 CAD	101.79%	354'113.40	0.05	a)
CA135087R481	3.0000 % CAN 3 06/01/34	0	725	0	725 CAD	100.37%	538'618.20	0.08	a)
CA135087R556	4.0000 % CAN 4 05/01/26	0	585	0	585 CAD	101.49%	439'467.75	0.07	a)
CA135087R713	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/34	0	95	0	95 CAD	104.75%	73'657.61	0.01	a)
CA135087R895	3.5000 % CAN 3 1/2 09/01/29	0	560	0	560 CAD	103.52%	429'126.77	0.07	a)
CA135087R978	4.0000 % CAN 4 08/01/26	0	475	0	475 CAD	101.93%	358'393.91	0.06	a)
CA135087S216	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/34	0	225	0	225 CAD	102.37%	170'496.69	0.03	a)
CA135087S398	3.2500 % CAN 3 1/4 11/01/26	0	150	0	150 CAD	100.87%	111'993.41	0.02	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	90	70	0	160 CAD	113.44%	134'346.94	0.02	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	170	0	0	170 CAD	121.37%	152'731.34	0.02	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	50	100	50	100 CAD	120.56%	89'239.42	0.01	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	70	75	0	145 CAD	111.73%	119'916.54	0.02	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	127	110	0	237 CAD	105.86%	185'712.43	0.03	a)
CA							11'113'009.47	1.71	
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	170	110	100	180 EUR	89.52%	179'835.27	0.03	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	47	150	197	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	120	155	0	275 EUR	53.75%	164'974.83	0.03	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	95	70	0	165 EUR	87.63%	161'359.40	0.02	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	100	100	0	200 EUR	98.27%	219'338.85	0.03	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	45	140	0	185 EUR	86.63%	178'863.75	0.03	a)
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	363	360	0	723 EUR	100.50%	810'920.00	0.12	a)
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	354	210	564	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	312	410	0	722 EUR	97.78%	787'913.26	0.12	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	351	350	0	701 EUR	96.36%	753'894.59	0.12	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	365	335	50	650 EUR	96.18%	697'718.80	0.11	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	350	350	0	700 EUR	96.23%	751'780.10	0.12	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	378	455	0	833 EUR	78.39%	728'719.28	0.11	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	300	330	0	630 EUR	95.61%	672'235.78	0.10	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	330	300	0	630 EUR	94.08%	661'478.21	0.10	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	317	305	0	622 EUR	93.32%	647'830.47	0.10	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	320	320	0	640 EUR	91.30%	652'106.87	0.10	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	451	450	0	901 EUR	53.67%	539'703.04	0.08	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	340	280	0	620 EUR	90.39%	625'445.64	0.10	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	365	400	0	765 EUR	89.55%	764'547.50	0.12	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	261	245	0	506 EUR	79.46%	448'743.09	0.07	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	235	220	0	455 EUR	94.28%	478'775.25	0.07	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	295	345	0	640 EUR	88.62%	633'000.16	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	280	280	0	560 EUR	77.22%	482'607.98	0.07	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	290	285	0	575 EUR	92.68%	594'726.68	0.09	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	345	375	0	720 EUR	87.65%	704'290.53	0.11	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	265	425	0	690 EUR	51.16%	393'961.19	0.06	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	350	370	0	720 EUR	86.65%	696'263.03	0.11	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	180	390	0	570 EUR	84.43%	537'111.23	0.08	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	305	295	0	600 EUR	97.94%	655'853.67	0.10	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	220	450	0	670 EUR	86.51%	646'857.10	0.10	a)
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	205	370	0	575 EUR	100.73%	646'392.10	0.10	a)
DE0001104909	2.2000 % BKO 2.2 12/12/24	130	0	130	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	179	180	50	309 EUR	111.97%	386'144.82	0.06	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	181	230	0	411 EUR	111.51%	511'504.69	0.08	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	150	150	0	300 EUR	110.15%	368'810.97	0.06	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	150	145	0	295 EUR	121.08%	398'639.48	0.06	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	232	210	0	442 EUR	120.46%	594'205.42	0.09	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	265	260	0	525 EUR	122.99%	720'640.17	0.11	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	305	320	0	625 EUR	118.08%	823'663.26	0.13	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	210	225	0	435 EUR	122.83%	596'334.79	0.09	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	257	255	50	462 EUR	130.36%	672'164.06	0.10	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	193	235	0	428 EUR	111.49%	532'547.18	0.08	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	330	350	0	680 EUR	100.46%	762'364.68	0.12	a)
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	280	0	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	298	310	300	308 EUR	97.63%	335'588.76	0.05	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	320	300	0	620 EUR	96.89%	670'408.47	0.10	a)
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	270	245	0	515 EUR	96.06%	552'112.51	0.09	a)
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	264	340	100	504 EUR	95.25%	535'769.29	0.08	a)
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	317	400	75	632 EUR	98.29%	693'280.06	0.11	a)
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	228	0	228	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU22015	2.8000 % BKO 2.8 06/12/25	225	145	370	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	80	230	310	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU22031	3.1000 % BKO 3.1 12/12/25 2Y	0	400	0	400 EUR	100.88%	450'324.77	0.07	a)
DE000BU22049	2.5000 % BKO 2 1/2 03/19/26 2Y	0	425	0	425 EUR	100.41%	476'264.48	0.07	a)
DE000BU22056	2.9000 % BKO 2.9 06/18/26	0	400	0	400 EUR	101.27%	452'065.80	0.07	a)
DE000BU22064	2.7000 % BKO 2.7 09/17/26	0	250	0	250 EUR	101.19%	282'337.45	0.04	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	300	210	0	510 EUR	100.95%	574'573.90	0.09	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	100	540	0	640 EUR	101.83%	727'305.20	0.11	a)
DE000BU25026	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 189	0	550	0	550 EUR	100.66%	617'846.14	0.10	a)
DE000BU25034	2.5000 % OBL 2 1/2 10/11/29 190	0	150	0	150 EUR	102.59%	171'744.49	0.03	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	0	555	0	555 EUR	102.39%	634'209.62	0.10	a)
DE000BU2D004	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/54	0	380	0	380 EUR	100.82%	427'566.80	0.07	a)
DE000BU2F009	2.6000 % DBR 2.6 05/15/41	0	130	0	130 EUR	102.15%	148'209.75	0.02	a)
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	411	405	0	816 EUR	102.07%	929'563.54	0.14	a)
DE000BU2Z015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	60	590	0	650 EUR	104.35%	756'971.94	0.12	a)
DE000BU2Z023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	0	795	0	795 EUR	100.88%	895'038.23	0.14	a)
DE000BU2Z031	2.6000 % DBR 2.6 08/15/34	0	350	0	350 EUR	104.15%	406'811.23	0.06	a)
DE000BU35025	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 G	0	100	0	100 EUR	100.67%	112'347.94	0.02	a)
DE000BU3Z005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	75	100	0	175 EUR	102.07%	199'345.16	0.03	a)
DE							34'333'952.70	5.29	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	1'230	1'015	0	2'245 DKK	127.54%	428'672.48	0.07	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	550	750	0	1'300 DKK	99.57%	193'788.45	0.03	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	650	580	0	1'230 DKK	96.06%	176'890.18	0.03	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	1'000	515	400	1'115 DKK	93.48%	156'039.90	0.02	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	700	680	0	1'380 DKK	57.57%	118'932.67	0.02	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	500	735	0	1'235 DKK	87.43%	161'643.64	0.02	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	650	0	650	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	500	720	0	1'220 DKK	101.67%	185'696.80	0.03	a)
DK0009924888	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/26	0	700	0	700 DKK	100.69%	105'518.22	0.02	a)
DK							1'527'182.34	0.24	
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	430	185	0	615 EUR	114.77%	787'731.53	0.12	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	219	240	0	459 EUR	118.76%	608'361.21	0.09	a)
ES0000012157	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	230	230	0	460 EUR	116.71%	599'167.43	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	230	330	560	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	260	290	0	550 EUR	106.28%	652'373.83	0.10 a)	
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	250	310	0	560 EUR	121.48%	759'226.81	0.12 a)	
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	50	385	0	435 EUR	110.65%	537'169.32	0.08 a)	
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	175	260	0	435 EUR	123.91%	601'548.85	0.09 a)	
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	200	100	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	257	270	0	527 EUR	97.08%	570'976.46	0.09 a)	
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	300	200	100	400 EUR	99.60%	444'628.47	0.07 a)	
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	230	245	0	475 EUR	99.36%	526'745.22	0.08 a)	
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	210	215	0	425 EUR	90.69%	430'151.11	0.07 a)	
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	178	185	0	363 EUR	93.96%	380'647.24	0.06 a)	
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	235	395	0	630 EUR	98.01%	689'117.43	0.11 a)	
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	315	240	0	555 EUR	98.04%	607'234.49	0.09 a)	
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	230	255	0	485 EUR	96.61%	522'949.32	0.08 a)	
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	170	340	0	510 EUR	111.11%	632'408.65	0.10 a)	
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	269	300	0	569 EUR	97.47%	618'989.60	0.10 a)	
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	256	340	0	596 EUR	96.83%	644'078.04	0.10 a)	
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	215	185	0	400 EUR	86.33%	385'388.72	0.06 a)	
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	280	280	0	560 EUR	96.56%	603'480.28	0.09 a)	
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	272	250	0	522 EUR	95.90%	558'679.00	0.09 a)	
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	280	255	50	485 EUR	89.63%	485'140.73	0.07 a)	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	245	300	0	545 EUR	91.29%	555'248.94	0.09 a)	
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	275	300	0	575 EUR	89.82%	576'392.55	0.09 a)	
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	234	285	0	519 EUR	57.01%	330'223.76	0.05 a)	
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	263	230	0	493 EUR	95.94%	527'844.86	0.08 a)	
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	270	350	0	620 EUR	92.85%	642'453.74	0.10 a)	
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	215	210	0	425 EUR	73.29%	347'628.96	0.05 a)	
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	208	280	100	388 EUR	96.82%	419'268.81	0.06 a)	
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	244	360	0	604 EUR	85.23%	574'542.18	0.09 a)	
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	80	90	0	170 EUR	51.15%	97'036.34	0.01 a)	
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	284	325	0	609 EUR	92.57%	629'193.07	0.10 a)	
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	193	155	0	348 EUR	75.64%	293'766.03	0.05 a)	
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	250	330	0	580 EUR	86.52%	560'017.64	0.09 a)	
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	95	200	0	295 EUR	68.19%	224'517.65	0.03 a)	
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	270	250	0	520 EUR	94.78%	550'050.22	0.08 a)	
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	270	320	0	590 EUR	86.72%	571'049.31	0.09 a)	
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	274	0	274	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	169	275	0	444 EUR	69.98%	346'758.24	0.05 a)	
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	249	335	0	584 EUR	92.60%	603'520.55	0.09 a)	
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	251	245	0	496 EUR	98.82%	546'999.40	0.08 a)	
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	120	130	0	250 EUR	99.31%	277'092.03	0.04 a)	
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	205	330	0	535 EUR	100.66%	601'001.77	0.09 a)	
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	250	300	0	550 EUR	102.85%	631'331.89	0.10 a)	
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	95	295	0	390 EUR	106.83%	465'003.68	0.07 a)	
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	200	355	0	555 EUR	105.68%	654'612.85	0.10 a)	
ES0000012M51	3.5000 % SPGB 3 1/2 05/31/29	0	485	0	485 EUR	104.63%	566'349.36	0.09 a)	
ES0000012M77	2.5000 % SPGB 2 1/2 05/31/27	0	465	0	465 EUR	100.41%	521'089.37	0.08 a)	
ES0000012M85	3.2500 % SPGB 3 1/4 04/30/34	0	550	0	550 EUR	103.04%	632'461.33	0.10 a)	
ES0000012M93	4.0000 % SPGB 4 10/31/54	0	160	0	160 EUR	105.25%	187'935.09	0.03 a)	
ES0000012N35	3.4500 % SPGB 3.45 10/31/34	0	400	0	400 EUR	104.47%	466'364.59	0.07 a)	
ES0000012N43	3.1000 % SPGB 3.1 07/30/31	0	100	0	100 EUR	102.97%	114'918.19	0.02 a)	
ES							26'160'866.14	4.03	
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25 15Y	0	110	110	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28 16Y	50	50	0	100 EUR	101.96%	113'792.10	0.02 a)	
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42 30Y	90	100	0	190 EUR	95.72%	202'981.63	0.03 a)	
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31 16Y	140	0	0	140 EUR	89.95%	140'548.43	0.02 a)	
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25 10Y	30	70	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26 10Y	100	0	0	100 EUR	97.36%	108'661.64	0.02 a)	
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	55	55	0	110 EUR	74.37%	91'304.10	0.01 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27 10Y	100	70	0	170 EUR	95.32%	180'841.05	0.03	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34 16Y	50	40	0	90 EUR	87.39%	87'777.17	0.01	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28 10Y	80	60	0	140 EUR	93.46%	146'020.18	0.02	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29 10Y	84	40	0	124 EUR	91.63%	126'803.78	0.02	a)
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36 16Y	50	50	0	100 EUR	73.98%	82'559.54	0.01	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40 20Y	20	50	0	70 EUR	66.16%	51'687.13	0.01	a)
FI4000441878	0.0000 % RFGB 0 09/15/30 10Y	0	110	0	110 EUR	86.89%	106'675.52	0.02	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52 31Y	50	30	0	80 EUR	48.02%	42'871.36	0.01	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31 10Y	70	50	0	120 EUR	85.31%	114'250.58	0.02	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26 5Y	100	0	0	100 EUR	95.81%	106'923.95	0.02	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43 21Y	55	40	0	95 EUR	65.26%	69'189.42	0.01	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32 10Y	50	100	0	150 EUR	92.61%	155'037.28	0.02	a)
FI4000527551	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/27 4Y	0	75	0	75 EUR	98.00%	82'028.58	0.01	a)
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38 15Y	50	20	0	70 EUR	98.56%	77'000.63	0.01	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33 10Y	60	90	0	150 EUR	103.19%	172'738.89	0.03	a)
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	0	140	0	140 EUR	102.50%	160'151.11	0.02	a)
FI4000566294	2.9500 % RFGB 2.95 04/15/55 31Y	0	120	0	120 EUR	98.71%	132'203.30	0.02	a)
FI4000571104	3.0000 % RFGB 3 09/15/34 10Y	0	130	0	130 EUR	102.95%	149'358.83	0.02	a)
FI4000577952	2.5000 % RFGB 2 1/2 04/15/30	0	100	0	100 EUR	100.83%	112'526.51	0.02	a)
FI							2'813'932.71	0.43	
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32 OAT	387	365	0	752 EUR	121.53%	1'019'961.16	0.16	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25 OAT	332	320	200	452 EUR	103.58%	522'512.45	0.08	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29 OAT	400	615	100	915 EUR	112.87%	1'152'608.76	0.18	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35 OAT	288	330	0	618 EUR	116.37%	802'623.38	0.12	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55 OAT	195	280	0	475 EUR	108.41%	574'705.37	0.09	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38 OAT	260	330	0	590 EUR	109.42%	720'495.08	0.11	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41 OAT	387	465	0	852 EUR	115.72%	1'100'348.66	0.17	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60 OAT	224	245	0	469 EUR	109.27%	571'947.39	0.09	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26 OAT	477	520	75	922 EUR	101.78%	1'047'311.00	0.16	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27 OAT	567	805	0	1'372 EUR	101.24%	1'550'202.90	0.24	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45 OAT	310	400	0	710 EUR	98.37%	779'477.02	0.12	a)
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30 OAT	649	850	75	1'424 EUR	99.89%	1'587'502.07	0.24	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24 OAT	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25 OAT	491	200	691	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25 OAT	430	370	0	800 EUR	98.37%	878'283.97	0.14	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31 OAT	665	805	0	1'470 EUR	93.44%	1'532'965.79	0.24	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26 OAT	550	665	100	1'115 EUR	97.11%	1'208'428.94	0.19	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66 OAT	190	220	0	410 EUR	63.29%	289'601.80	0.04	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36 OAT	548	460	0	1'008 EUR	82.73%	930'691.73	0.14	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26 OAT	476	440	70	846 EUR	95.75%	904'047.90	0.14	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 OAT	360	415	0	775 EUR	83.42%	721'529.66	0.11	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27 OAT	450	520	0	970 EUR	96.66%	1'046'407.45	0.16	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48 OAT	320	350	0	670 EUR	77.23%	577'488.23	0.09	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28 OAT	712	690	50	1'352 EUR	94.43%	1'424'849.45	0.22	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34 OAT	500	740	0	1'240 EUR	86.46%	1'196'517.94	0.18	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28 OAT	640	675	0	1'315 EUR	93.51%	1'372'353.86	0.21	a)
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50 OAT	390	345	0	735 EUR	67.10%	550'417.40	0.08	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29 OAT	663	645	0	1'308 EUR	91.49%	1'335'560.82	0.21	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25 OAT	540	0	540	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29 OAT	500	520	0	1'020 EUR	88.10%	1'002'901.72	0.15	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52 OAT	319	400	0	719 EUR	52.43%	420'717.95	0.06	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26 OAT	492	500	0	992 EUR	96.79%	1'071'579.66	0.17	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	290	310	0	600 EUR	66.62%	446'106.11	0.07	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30 OAT	617	640	0	1'257 EUR	85.59%	1'200'716.84	0.18	a)
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072 OAT	136	150	0	286 EUR	36.15%	115'386.93	0.02	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44 OAT	230	255	0	485 EUR	59.55%	322'333.77	0.05	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31 OAT	575	770	100	1'245 EUR	82.98%	1'152'988.78	0.18	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27 OAT	474	560	0	1'034 EUR	94.68%	1'092'599.72	0.17	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53 OAT	355	395	0	750 EUR	51.09%	427'641.13	0.07	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32 OAT	425	440	0	865 EUR	81.63%	788'039.89	0.12	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25 OAT	400	250	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FR0014009062	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 OAT	150	510	0	660 EUR	78.92%	581'317.38	0.09	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28 OAT	501	610	0	1'111 EUR	94.81%	1'175'575.44	0.18	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32 OAT	560	530	0	1'090 EUR	94.60%	1'150'800.21	0.18	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43 OAT	150	300	0	450 EUR	88.36%	443'762.42	0.07	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54 OAT	185	390	0	575 EUR	90.21%	578'901.70	0.09	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26 OAT	315	710	0	1'025 EUR	100.35%	1'147'951.50	0.18	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33 OAT	285	625	0	910 EUR	101.56%	1'031'445.73	0.16	a)
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29 OAT	120	1'022	0	1'142 EUR	101.18%	1'289'056.38	0.20	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33 OAT	0	1'060	0	1'060 EUR	105.27%	1'245'353.90	0.19	a)
FR001400NBC6	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/27 OAT	0	595	0	595 EUR	100.47%	667'168.70	0.10	a)
FR001400NEF3	3.0000 % FRTR 3 06/25/49 OAT	0	165	0	165 EUR	92.89%	171'054.78	0.03	a)
FR001400OHF4	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/55 OAT	0	318	0	318 EUR	94.25%	334'358.08	0.05	a)
FR001400PM68	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/30 OAT	0	400	0	400 EUR	101.02%	450'972.08	0.07	a)
FR001400QMF9	3.0000 % FRTR 3 11/25/34 OAT	0	350	0	350 EUR	100.65%	393'155.29	0.06	a)
FR							44'100'726.27	6.79	
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	145	115	0	260 GBP	108.79%	379'406.21	0.06	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	220	280	0	500 GBP	102.72%	688'917.36	0.11	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	230	0	230	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	185	255	0	440 GBP	101.44%	598'692.79	0.09	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	165	225	0	390 GBP	105.43%	551'532.27	0.08	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	205	210	0	415 GBP	94.74%	527'379.92	0.08	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	181	190	0	371 GBP	95.93%	477'386.87	0.07	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	150	200	0	350 GBP	101.41%	476'092.06	0.07	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	191	255	0	446 GBP	100.76%	602'788.74	0.09	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	210	270	0	480 GBP	105.23%	677'521.25	0.10	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	135	235	50	320 GBP	95.37%	409'358.56	0.06	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	137	160	0	297 GBP	99.43%	396'110.18	0.06	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	160	185	0	345 GBP	104.10%	481'739.15	0.07	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	120	180	0	300 GBP	90.74%	365'142.30	0.06	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	160	175	0	335 GBP	98.69%	473'465.74	0.07	a)
GB00B6RNHS72	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	155	165	0	320 GBP	87.17%	374'161.53	0.06	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	210	250	0	460 GBP	84.03%	518'482.75	0.08	a)
GB00BBJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	164	215	0	379 GBP	81.58%	414'729.59	0.06	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	210	220	0	430 GBP	53.25%	307'135.62	0.05	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	239	210	50	399 GBP	57.25%	306'401.23	0.05	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	180	240	0	420 GBP	93.40%	526'184.78	0.08	a)
GB00BFMCMN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	155	295	0	450 GBP	46.16%	278'625.22	0.04	a)
GB00BFVFP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	109	160	0	269 GBP	59.29%	213'932.05	0.03	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	180	150	0	330 GBP	92.32%	408'650.33	0.06	a)
GB00BJLR0J16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	140	170	0	310 GBP	52.56%	218'554.20	0.03	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	155	200	0	355 GBP	87.04%	414'466.42	0.06	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	272	275	0	547 GBP	62.71%	460'114.84	0.07	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	190	0	190	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	200	200	0	400 GBP	81.91%	439'479.91	0.07	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	178	150	0	328 GBP	95.37%	419'592.52	0.06	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	360	340	0	700 GBP	100.29%	941'667.94	0.15	a)
GB00BLBDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	135	70	0	205 GBP	37.16%	102'181.36	0.02	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	266	315	0	581 GBP	49.33%	384'440.70	0.06	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	154	200	354	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	327	285	0	612 GBP	87.14%	715'337.66	0.11	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	264	280	0	544 GBP	66.81%	487'508.83	0.08	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	230	420	0	650 GBP	77.32%	674'135.68	0.10	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	420	340	0	760 GBP	81.93%	835'215.72	0.13	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	165	320	0	485 GBP	51.36%	334'124.92	0.05	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	330	130	0	460 GBP	30.51%	188'253.11	0.03	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	247	220	60	407 GBP	41.13%	224'540.78	0.03	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	90	370	0	460 GBP	89.01%	549'210.39	0.08	a)
GB00BMF9LF76	4.0000 % UKT 4 10/22/63	0	405	0	405 GBP	90.28%	490'443.17	0.08	a)
GB00BMF9LG83	4.5000 % UKT 4 1/2 06/07/28	100	695	0	795 GBP	102.12%	1'088'980.36	0.17	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	338	280	0	618 GBP	78.86%	653'713.36	0.10	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	245	290	0	535 GBP	70.31%	504'560.20	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	281	465	0	746 GBP	95.19%	952'515.97	0.15	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	262	305	60	507 GBP	86.60%	588'935.81	0.09	a)
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	313	290	0	603 GBP	93.30%	754'642.17	0.12	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	170	250	50	370 GBP	50.67%	251'474.96	0.04	a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	150	660	0	810 GBP	99.07%	1'076'389.11	0.17	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	113	475	0	588 GBP	86.73%	684'051.48	0.11	a)
GB00BPJKN53	4.6250 % UKT 4 5/8 01/31/34	0	695	0	695 GBP	104.95%	978'384.04	0.15	a)
GB00BPJKP77	4.7500 % UKT 4 3/4 10/22/43	0	535	40	495 GBP	103.41%	686'609.57	0.11	a)
GB00BPSNB460	3.7500 % UKT 3 3/4 03/07/27	0	685	0	685 GBP	99.47%	913'954.98	0.14	a)
GB00BPSNBB36	4.3750 % UKT 4 3/8 07/31/54	0	350	0	350 GBP	96.55%	453'275.70	0.07	a)
GB00BPSNBF73	4.0000 % UKT 4 10/22/31	0	275	0	275 GBP	100.60%	371'084.48	0.06	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	190	420	0	610 GBP	95.52%	781'567.09	0.12	a)
GB00BQC82B83	4.1250 % UKT 4 1/8 07/22/29	0	475	0	475 GBP	101.12%	644'277.23	0.10	a)
GB00BQC82C90	4.2500 % UKT 4 1/4 07/31/34	0	350	0	350 GBP	101.94%	478'580.27	0.07	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	214	140	354	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BYMZX75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	190	150	0	340 GBP	63.32%	288'753.76	0.04	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	173	230	0	403 GBP	95.89%	518'319.84	0.08	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	220	250	0	470 GBP	76.12%	479'886.74	0.07	a)
GB							31'453'061.77	4.84	
IE000GLVBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	12	50	0	62 EUR	103.01%	71'277.65	0.01	a)
IE000LQ7YWY4	2.6000 % IRISH 2.6 10/18/34	0	110	0	110 EUR	100.97%	123'955.94	0.02	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	90	50	140	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDP44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	100	60	0	160 EUR	95.93%	171'299.75	0.03	a)
IE00BFZRP202	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	50	100	0	150 EUR	91.76%	153'612.64	0.02	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	100	100	0	200 EUR	94.60%	211'156.00	0.03	a)
IE00BH35SQ895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	110	130	0	240 EUR	95.35%	255'396.09	0.04	a)
IE00BH35QB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	85	90	0	175 EUR	75.88%	148'199.82	0.02	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	100	70	0	170 EUR	100.98%	191'587.24	0.03	a)
IE00BKFVC345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	65	30	0	95 EUR	80.11%	84'936.16	0.01	a)
IE00BKFVC568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	50	140	0	190 EUR	95.25%	201'976.52	0.03	a)
IE00BKFVC899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	100	50	0	150 EUR	88.54%	148'222.14	0.02	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	86	0	0	86 EUR	85.63%	82'187.67	0.01	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	75	100	0	175 EUR	85.30%	166'597.84	0.03	a)
IE00BMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	90	40	50	80 EUR	70.82%	63'230.73	0.01	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	140	145	0	285 EUR	86.98%	276'660.12	0.04	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	130	80	0	210 EUR	98.11%	229'940.18	0.04	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	40	150	0	190 EUR	89.64%	190'080.58	0.03	a)
IE							2'770'317.07	0.43	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	300	0	0	300 ILS	103.76%	83'687.15	0.01	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	250	100	0	350 ILS	103.68%	97'554.71	0.02	a)
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	300	140	0	440 ILS	97.87%	115'771.17	0.02	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	300	150	0	450 ILS	94.44%	114'247.83	0.02	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	230	250	0	480 ILS	79.48%	102'562.93	0.02	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	150	390	0	540 ILS	91.90%	133'413.98	0.02	a)
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	420	280	0	700 ILS	82.74%	155'703.52	0.02	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	250	0	250	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	200	360	0	560 ILS	67.42%	101'498.59	0.02	a)
IL0011746976	0.5000 % ILGOV 0 1/2 02/27/26 0226	0	500	0	500 ILS	94.81%	127'438.84	0.02	a)
IL0011806606	1.3000 % ILGOV 1.3 04/30/32 0432	0	530	0	530 ILS	78.44%	111'757.90	0.02	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	100	190	0	290 ILS	62.36%	48'618.11	0.01	a)
IL0011948028	3.7500 % ILGOV 3 3/4 02/28/29 0229	0	800	0	800 ILS	96.82%	208'234.79	0.03	a)
IL0012023326	4.0000 % ILGOV 4 03/30/35 0335	0	450	0	450 ILS	92.92%	112'417.76	0.02	a)
IL0012035791	3.7500 % ILGOV 3 3/4 09/30/27 0927	0	120	0	120 ILS	98.09%	31'644.49	0.00	a)
IL							1'544'551.77	0.24	
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	150	130	0	280 EUR	109.84%	343'251.71	0.05	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	260	350	0	610 EUR	112.01%	762'551.06	0.12	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	540	140	0	680 EUR	112.00%	849'958.26	0.13	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	390	300	0	690 EUR	118.31%	911'056.90	0.14	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	510	200	150	560 EUR	118.54%	740'864.71	0.11	a)
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	320	290	0	610 EUR	114.02%	776'241.72	0.12	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	391	330	0	721 EUR	105.04%	845'200.75	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	230	415	50	595 EUR	114.00%	757'007.71	0.12	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	260	50	310	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	170	350	0	520 EUR	114.00%	661'569.16	0.10	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	280	200	0	480 EUR	102.75%	550'412.72	0.08	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	249	295	0	544 EUR	108.00%	655'669.29	0.10	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	179	280	0	459 EUR	111.55%	571'447.37	0.09	a)
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	320	320	0	640 EUR	103.76%	741'090.60	0.11	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24 10Y	200	100	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	200	205	0	405 EUR	90.36%	408'435.19	0.06	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	200	50	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	310	300	0	610 EUR	90.92%	618'959.18	0.10	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	221	210	0	431 EUR	99.41%	478'192.49	0.07	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	200	200	0	400 EUR	82.21%	367'000.74	0.06	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	220	300	0	520 EUR	98.70%	572'805.52	0.09	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	180	190	0	370 EUR	87.92%	363'033.75	0.06	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	270	165	0	435 EUR	97.66%	474'139.42	0.07	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	115	90	0	205 EUR	76.33%	174'630.48	0.03	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	105	320	0	425 EUR	94.30%	447'283.54	0.07	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	230	240	0	470 EUR	99.49%	521'887.68	0.08	a)
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	200	190	0	390 EUR	92.67%	403'358.07	0.06	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	200	210	0	410 EUR	98.99%	452'971.25	0.07	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24 7Y	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	175	150	0	325 EUR	92.22%	334'481.37	0.05	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	285	230	0	515 EUR	98.50%	566'119.51	0.09	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	144	0	144	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	321	190	0	511 EUR	100.88%	575'301.30	0.09	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	230	180	100	310 EUR	99.99%	345'943.28	0.05	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	170	240	0	410 EUR	99.62%	455'831.12	0.07	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	95	315	0	410 EUR	98.05%	448'656.28	0.07	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	270	250	0	520 EUR	101.34%	588'138.21	0.09	a)
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	107	275	0	382 EUR	99.46%	424'040.38	0.07	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	175	140	0	315 EUR	92.17%	324'027.92	0.05	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	320	200	0	520 EUR	92.66%	537'723.71	0.08	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	207	0	207	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	220	205	0	425 EUR	96.60%	458'178.67	0.07	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	206	200	50	356 EUR	75.88%	301'496.66	0.05	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	160	170	0	330 EUR	81.10%	298'669.12	0.05	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	190	215	0	405 EUR	89.77%	405'759.36	0.06	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	250	120	370	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	255	240	0	495 EUR	92.86%	512'970.97	0.08	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	245	215	0	460 EUR	95.80%	491'819.38	0.08	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	229	190	0	419 EUR	97.37%	455'334.35	0.07	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	200	180	0	380 EUR	75.63%	320'749.31	0.05	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	285	270	0	555 EUR	87.96%	544'798.39	0.08	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	190	210	0	400 EUR	63.76%	284'640.97	0.04	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	190	185	0	375 EUR	74.11%	310'159.09	0.05	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	193	210	0	403 EUR	92.59%	416'434.53	0.06	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	230	260	0	490 EUR	85.40%	467'026.30	0.07	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	250	230	0	480 EUR	96.42%	516'529.54	0.08	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	159	140	0	299 EUR	66.94%	223'377.38	0.03	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	65	90	0	155 EUR	63.09%	109'135.90	0.02	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	150	200	0	350 EUR	92.70%	362'105.20	0.06	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	210	245	0	455 EUR	86.80%	440'791.72	0.07	a)
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	195	200	0	395 EUR	95.73%	422'010.17	0.06	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	100	345	0	445 EUR	85.66%	425'427.39	0.07	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	200	150	0	350 EUR	91.04%	355'620.97	0.05	a)
IT0005474330	0.0000 % BTPS 0 12/15/24 3Y	180	0	180	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	100	100	0	200 EUR	69.53%	155'206.36	0.02	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	150	215	0	365 EUR	96.82%	394'403.03	0.06	a)
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	150	130	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	250	155	0	405 EUR	95.61%	432'138.01	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	150	215	0	365 EUR	100.42%	409'084.17	0.06	a)
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	135	175	0	310 EUR	95.66%	330'966.05	0.05	a)
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	192	190	0	382 EUR	100.59%	428'828.06	0.07	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	137	160	0	297 EUR	105.59%	349'994.76	0.05	a)
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	139	280	100	319 EUR	101.14%	360'066.77	0.06	a)
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	0	490	0	490 EUR	109.10%	596'621.84	0.09	a)
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	0	500	0	500 EUR	105.13%	586'638.69	0.09	a)
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	181	210	0	391 EUR	102.87%	448'893.76	0.07	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	105	205	0	310 EUR	106.94%	369'967.75	0.06	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	78	230	0	308 EUR	106.95%	367'646.17	0.06	a)
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	206	140	0	346 EUR	101.93%	393'604.83	0.06	a)
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	105	135	0	240 EUR	106.48%	285'205.24	0.04	a)
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	200	150	0	350 EUR	104.23%	407'135.44	0.06	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	100	355	0	455 EUR	108.56%	551'248.63	0.08	a)
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	50	325	0	375 EUR	104.36%	436'756.44	0.07	a)
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	50	340	0	390 EUR	102.65%	446'788.13	0.07	a)
IT0005557084	3.6000 % BTPS 3.6 09/29/25 2Y	0	290	290	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005560948	4.2000 % BTPS 4.2 03/01/34 10Y	0	430	0	430 EUR	107.14%	514'162.90	0.08	a)
IT0005561888	4.0000 % BTPS 4 11/15/30 7Y	0	340	0	340 EUR	105.84%	401'628.67	0.06	a)
IT0005566408	4.1000 % BTPS 4.1 02/01/29 5Y	0	390	0	390 EUR	105.78%	460'411.71	0.07	a)
IT0005580045	2.9500 % BTPS 2.95 02/15/27 3Y	0	400	0	400 EUR	101.13%	451'449.75	0.07	a)
IT0005580094	3.5000 % BTPS 3 1/2 02/15/31 7Y	0	370	0	370 EUR	103.00%	425'329.46	0.07	a)
IT0005582421	4.1500 % BTPS 4.15 10/01/39 15Y	0	300	0	300 EUR	104.31%	349'247.79	0.05	a)
IT0005584302	3.2000 % BTPS 3.2 01/28/26 2Y	0	360	0	360 EUR	100.76%	404'846.32	0.06	a)
IT0005584849	3.3500 % BTPS 3.35 07/01/29 5Y	0	410	0	410 EUR	102.70%	469'915.41	0.07	a)
IT0005584856	3.8500 % BTPS 3.85 07/01/34 10Y	0	430	0	430 EUR	104.12%	499'662.29	0.08	a)
IT0005595803	3.4500 % BTPS 3.45 07/15/31 7Y	0	230	0	230 EUR	102.58%	263'310.75	0.04	a)
IT0005596470	4.0500 % BTPS 4.05 10/30/37 13Y	0	200	0	200 EUR	104.83%	233'983.62	0.04	a)
IT0005599904	3.4500 % BTPS 3.45 07/15/27 3Y	0	225	0	225 EUR	102.59%	257'604.18	0.04	a)
IT0005607269	3.1000 % BTPS 3.1 08/28/26 2Y	0	100	0	100 EUR	101.11%	112'846.81	0.02	a)
IT0005607970	3.8500 % BTPS 3.85 02/01/35 11Y	0	150	0	150 EUR	103.63%	173'487.20	0.03	a)
IT							39'941'398.71	6.15	
JP1024421NB7	0.0050 % JGB 0.005 11/01/24 442	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024441P12	0.0050 % JGB 0.005 01/01/25 444	35'000	0	35'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024451P27	0.0050 % JGB 0.005 02/01/25 445	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	23'000	0	23'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024471P49	0.0050 % JGB 0.005 04/01/25 447	27'000	0	27'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024481P54	0.0050 % JGB 0.005 05/01/25 448	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024491P60	0.0050 % JGB 0.005 06/01/25 449	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024501P76	0.0050 % JGB 0.005 07/01/25 450	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024511P82	0.0050 % JGB 0.005 08/01/25 451	0	50'000	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024521P98	0.0050 % JGB 0.005 09/01/25 452	0	50'000	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024531PA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/25 453	0	35'000	5'000	30'000 JPY	99.78%	209'276.38	0.03	a)
JP1024541PB7	0.1000 % JGB 0.1 11/01/25 454	0	30'000	0	30'000 JPY	99.85%	209'406.42	0.03	a)
JP1024551PC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/25 455	0	40'000	0	40'000 JPY	99.69%	278'775.11	0.04	a)
JP1024561Q15	0.1000 % JGB 0.1 01/01/26 456	0	40'000	0	40'000 JPY	99.76%	278'973.66	0.04	a)
JP1024571Q21	0.1000 % JGB 0.1 02/01/26 457	0	50'000	0	50'000 JPY	99.73%	348'619.19	0.05	a)
JP1024581Q37	0.2000 % JGB 0.2 03/01/26 458	0	50'000	0	50'000 JPY	99.83%	348'968.75	0.05	a)
JP1024591Q43	0.2000 % JGB 0.2 04/01/26 459	0	45'000	0	45'000 JPY	99.81%	313'996.37	0.05	a)
JP1024601Q58	0.3000 % JGB 0.3 05/01/26 460	0	50'000	0	50'000 JPY	99.94%	349'346.26	0.05	a)
JP1024611Q64	0.4000 % JGB 0.4 06/01/26 461	0	45'000	0	45'000 JPY	100.09%	314'874.10	0.05	a)
JP1024621Q70	0.4000 % JGB 0.4 07/01/26 462	0	45'000	0	45'000 JPY	100.08%	314'836.34	0.05	a)
JP1024631Q86	0.4000 % JGB 0.4 08/01/26 463	0	60'000	0	60'000 JPY	100.06%	419'718.87	0.06	a)
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	20'000	20'000	0	40'000 JPY	99.78%	279'037.97	0.04	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	30'000	30'000	10'000	50'000 JPY	99.53%	347'920.09	0.05	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	0	30'000	0	30'000 JPY	99.41%	208'483.60	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	20'000	25'000	0	45'000 JPY	99.28%	312'341.59	0.05	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	25'000	20'000	0	45'000 JPY	99.18%	242'017.55	0.05	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	20'000	15'000	0	35'000 JPY	99.10%	312'494.36	0.04	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	20'000	20'000	15'000	25'000 JPY	99.34%	173'615.74	0.03	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	10'000	30'000	0	40'000 JPY	99.00%	276'853.97	0.04	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	35'000	10'000	0	45'000 JPY	99.15%	311'923.17	0.05	a)
JP1051551P11	0.3000 % JGB 0.3 12/20/27 155	0	30'000	0	30'000 JPY	99.71%	209'112.79	0.03	a)
JP1051561P27	0.2000 % JGB 0.2 12/20/27 156	48'000	0	0	48'000 JPY	99.39%	333'513.35	0.05	a)
JP1051571P41	0.2000 % JGB 0.2 03/20/28 157	27'000	0	0	27'000 JPY	99.29%	187'420.05	0.03	a)
JP1051581P56	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 158	50'000	0	0	50'000 JPY	98.95%	345'882.20	0.05	a)
JP1051591P70	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 159	10'000	20'000	0	30'000 JPY	98.82%	207'260.86	0.03	a)
JP1051601P86	0.2000 % JGB 0.2 06/20/28 160	0	20'000	0	20'000 JPY	99.19%	138'685.65	0.02	a)
JP1051611P92	0.3000 % JGB 0.3 06/20/28 161	0	20'000	0	20'000 JPY	99.55%	139'197.40	0.02	a)
JP1051621PA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/28 162	0	35'000	0	35'000 JPY	99.47%	243'387.46	0.04	a)
JP1051631PB2	0.4000 % JGB 0.4 09/20/28 163	0	40'000	0	40'000 JPY	99.86%	279'247.70	0.04	a)
JP1051641Q12	0.2000 % JGB 0.2 12/20/28 164	0	30'000	0	30'000 JPY	98.94%	207'497.86	0.03	a)
JP1051651Q27	0.3000 % JGB 0.3 12/20/28 165	0	40'000	0	40'000 JPY	99.35%	277'821.53	0.04	a)
JP1051661Q33	0.4000 % JGB 0.4 12/20/28 166	0	40'500	0	40'500 JPY	99.76%	282'466.49	0.04	a)
JP1051671Q49	0.4000 % JGB 0.4 03/20/29 167	0	38'000	0	38'000 JPY	99.66%	264'756.66	0.04	a)
JP1051681Q54	0.6000 % JGB 0.6 03/20/29 168	0	30'000	0	30'000 JPY	100.53%	210'851.47	0.03	a)
JP1051691Q60	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/29 169	0	30'000	0	30'000 JPY	100.10%	209'934.94	0.03	a)
JP1051701Q76	0.6000 % JGB 0.6 06/20/29 170	0	45'000	0	45'000 JPY	100.47%	316'072.71	0.05	a)
JP1051711Q82	0.4000 % JGB 0.4 06/20/29 171	0	60'000	0	60'000 JPY	99.55%	417'562.83	0.06	a)
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	62'000	0	62'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	0	20'000	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	0	20'000	0	20'000 JPY	100.03%	139'858.75	0.02	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	10'000	10'000	0	20'000 JPY	99.67%	139'360.99	0.02	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	10'000	10'000	0	20'000 JPY	99.57%	139'215.58	0.02	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	22'000	0	0	22'000 JPY	99.47%	152'986.41	0.02	a)
JP1103451GCO	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	32'500	0	0	32'500 JPY	99.39%	225'820.88	0.03	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	25'000	0	0	25'000 JPY	99.34%	173'615.74	0.03	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	50'500	0	0	50'500 JPY	99.26%	350'428.41	0.05	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	10'000	15'000	0	25'000 JPY	99.15%	173'290.65	0.03	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	30'000	0	0	30'000 JPY	99.07%	207'778.90	0.03	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	15'000	10'000	0	25'000 JPY	98.95%	172'941.10	0.03	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	25'000	0	0	25'000 JPY	98.82%	172'717.39	0.03	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	15'000	0	0	15'000 JPY	98.69%	103'489.91	0.02	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	13'000	0	0	13'000 JPY	98.52%	89'539.48	0.01	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	14'000	0	0	14'000 JPY	98.35%	96'257.81	0.01	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	20'000	0	0	20'000 JPY	98.16%	137'253.89	0.02	a)
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	0	19'000	0	19'000 JPY	98.07%	130'262.35	0.02	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	11'000	15'000	0	26'000 JPY	97.92%	177'986.54	0.03	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	25'000	0	25'000 JPY	97.82%	170'971.37	0.03	a)
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	11'000	10'000	0	21'000 JPY	97.67%	143'391.33	0.02	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	10'000	10'000	0	20'000 JPY	97.51%	136'343.65	0.02	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	5'000	20'000	0	25'000 JPY	97.29%	170'045.06	0.03	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	23'000	20'000	15'000	28'000 JPY	97.12%	190'111.82	0.03	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	32'000	30'000	15'000	47'000 JPY	96.87%	318'307.96	0.05	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	20'000	10'000	0	30'000 JPY	96.62%	202'640.48	0.03	a)
JP1103651N11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/31 365	0	20'000	0	20'000 JPY	96.39%	134'772.06	0.02	a)
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	0	20'000	0	20'000 JPY	96.66%	135'146.78	0.02	a)
JP1103681NA2	0.2000 % JGB 0.2 09/20/32 368	0	18'000	0	18'000 JPY	96.36%	121'259.62	0.02	a)
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	10'000	10'000	0	20'000 JPY	98.54%	137'779.61	0.02	a)
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	27'000	10'000	0	37'000 JPY	98.28%	254'211.99	0.04	a)
JP1103711P74	0.4000 % JGB 0.4 06/20/33 371	17'000	55'000	0	72'000 JPY	97.19%	489'196.21	0.08	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	72'500	0	72'500 JPY	100.33%	508'503.46	0.08	a)
JP1103731Q12	0.6000 % JGB 0.6 12/20/33 373	0	122'000	0	122'000 JPY	98.23%	837'845.74	0.13	a)
JP1103741Q44	0.8000 % JGB 0.8 03/20/34 374	0	118'000	0	118'000 JPY	99.75%	822'914.54	0.13	a)
JP1103751Q74	1.1000 % JGB 1.1 06/20/34 375	0	90'000	0	90'000 JPY	102.24%	643'294.75	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200811592	2.0000 % JGB 2 09/20/25 81	0	10'000	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP12008315C1	2.1000 % JGB 2.1 12/20/25 83	0	10'000	0	10'000 JPY	102.21%	71'458.32	0.01 a)	
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	25'000	0	0	25'000 JPY	102.09%	178'434.32	0.03 a)	
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	20'000	0	0	20'000 JPY	102.60%	143'461.94	0.02 a)	
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	12'000	0	0	12'000 JPY	102.90%	86'322.13	0.01 a)	
JP1200871653	2.2000 % JGB 2.2 03/20/26 87	0	10'000	0	10'000 JPY	102.75%	71'833.04	0.01 a)	
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	10'000	10'000	0	20'000 JPY	103.32%	144'468.65	0.02 a)	
JP1200891685	2.2000 % JGB 2.2 06/20/26 89	0	10'000	0	10'000 JPY	103.15%	72'114.78	0.01 a)	
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	13'000	10'000	0	23'000 JPY	103.58%	166'542.54	0.03 a)	
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	16'000	25'000	0	41'000 JPY	103.81%	297'562.37	0.05 a)	
JP1200931739	2.0000 % JGB 2 03/20/27 93	0	25'000	0	25'000 JPY	104.00%	181'774.29	0.03 a)	
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	11'000	10'000	0	21'000 JPY	104.25%	153'048.63	0.02 a)	
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	10'000	0	0	10'000 JPY	105.21%	73'549.34	0.01 a)	
JP1200961785	2.1000 % JGB 2.1 06/20/27 96	0	20'000	0	20'000 JPY	104.67%	146'346.45	0.02 a)	
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	20'000	0	0	20'000 JPY	105.35%	147'295.83	0.02 a)	
JP12009817B7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/27 98	0	15'000	0	15'000 JPY	105.05%	110'163.57	0.02 a)	
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	0	31'000	0	31'000 JPY	105.46%	228'555.60	0.04 a)	
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	15'000	0	0	15'000 JPY	106.16%	111'328.63	0.02 a)	
JP1201011853	2.4000 % JGB 2.4 03/20/28 101	0	10'000	0	10'000 JPY	106.85%	74'697.27	0.01 a)	
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	10'000	10'000	0	20'000 JPY	107.28%	149'999.97	0.02 a)	
JP1201031877	2.3000 % JGB 2.3 06/20/28 103	0	10'000	0	10'000 JPY	106.91%	74'744.11	0.01 a)	
JP1201041884	2.1000 % JGB 2.1 06/20/28 104	0	10'000	0	10'000 JPY	106.18%	74'232.37	0.01 a)	
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	12'000	10'000	0	22'000 JPY	106.53%	163'852.59	0.03 a)	
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	10'000	0	0	10'000 JPY	106.93%	74'751.80	0.01 a)	
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	15'000	0	0	15'000 JPY	106.89%	112'088.90	0.02 a)	
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	10'000	10'000	0	20'000 JPY	106.06%	148'294.15	0.02 a)	
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	11'000	10'000	0	21'000 JPY	106.27%	156'009.82	0.02 a)	
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	12'000	20'000	0	32'000 JPY	107.19%	239'791.90	0.04 a)	
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	0	20'000	0	20'000 JPY	107.89%	150'858.47	0.02 a)	
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	14'000	10'000	0	24'000 JPY	107.43%	180'255.00	0.03 a)	
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	10'000	10'000	0	20'000 JPY	107.87%	150'826.31	0.02 a)	
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	15'000	5'000	0	20'000 JPY	108.20%	151'283.53	0.02 a)	
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	10'000	0	0	10'000 JPY	108.71%	75'997.61	0.01 a)	
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	10'000	10'000	0	20'000 JPY	109.11%	152'554.50	0.02 a)	
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	20'000	0	0	20'000 JPY	108.57%	151'809.25	0.02 a)	
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	10'000	15'000	0	25'000 JPY	108.34%	189'354.34	0.03 a)	
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	9'000	0	0	9'000 JPY	107.23%	67'467.90	0.01 a)	
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	10'000	10'000	0	20'000 JPY	106.06%	148'291.36	0.02 a)	
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	12'000	10'000	0	22'000 JPY	108.06%	166'191.94	0.03 a)	
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	9'000	15'000	0	24'000 JPY	107.48%	180'328.82	0.03 a)	
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	15'000	35'000	0	50'000 JPY	109.52%	382'822.91	0.06 a)	
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	15'000	0	0	15'000 JPY	108.92%	114'214.53	0.02 a)	
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	15'000	10'000	0	25'000 JPY	110.43%	193'003.67	0.03 a)	
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	10'000	10'000	0	20'000 JPY	109.11%	152'560.09	0.02 a)	
JP1201271B58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/31 127	0	25'000	0	25'000 JPY	108.49%	189'607.76	0.03 a)	
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	25'500	5'500	0	31'000 JPY	108.72%	235'620.76	0.04 a)	
JP1201291B88	1.8000 % JGB 1.8 06/20/31 129	0	10'000	0	10'000 JPY	108.07%	75'554.37	0.01 a)	
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	34'500	0	0	34'500 JPY	108.21%	260'980.97	0.04 a)	
JP1201311BB0	1.7000 % JGB 1.7 09/20/31 131	0	20'000	0	20'000 JPY	107.54%	150'356.51	0.02 a)	
JP1201321BC7	1.7000 % JGB 1.7 12/20/31 132	0	27'000	0	27'000 JPY	107.67%	203'228.57	0.03 a)	
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	53'000	0	0	53'000 JPY	108.36%	401'494.18	0.06 a)	
JP1201341C38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/32 134	0	20'000	0	20'000 JPY	108.51%	151'715.57	0.02 a)	
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	20'000	0	0	20'000 JPY	107.79%	150'717.25	0.02 a)	
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	17'000	0	0	17'000 JPY	107.08%	127'261.09	0.02 a)	
JP1201371C64	1.7000 % JGB 1.7 06/20/32 137	0	10'000	0	10'000 JPY	107.92%	75'443.92	0.01 a)	
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	15'000	0	0	15'000 JPY	106.36%	111'539.41	0.02 a)	
JP1201391C86	1.6000 % JGB 1.6 06/20/32 139	0	20'000	0	20'000 JPY	107.18%	149'858.75	0.02 a)	
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	28'500	10'000	0	38'500 JPY	108.03%	290'760.53	0.04 a)	
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	31'000	0	0	31'000 JPY	108.04%	234'155.71	0.04 a)	
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	11'000	5'000	0	16'000 JPY	108.91%	121'821.00	0.02 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	17'000	5'000	0	22'000 JPY	107.31%	165'052.26	0.03	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	12'000	0	0	12'000 JPY	106.51%	89'357.36	0.01	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	26'500	10'000	0	36'500 JPY	108.10%	275'832.16	0.04	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	26'000	10'000	0	36'000 JPY	108.06%	271'973.10	0.04	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	17'000	10'000	0	27'000 JPY	107.09%	202'143.20	0.03	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	25'000	15'000	0	40'000 JPY	106.09%	296'658.22	0.05	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	20'000	20'000	0	40'000 JPY	105.93%	296'216.38	0.05	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	22'500	20'000	0	42'500 JPY	104.84%	311'497.24	0.05	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	27'000	25'000	0	52'000 JPY	102.78%	373'633.59	0.06	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	21'000	20'000	0	41'000 JPY	102.52%	293'856.20	0.05	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	20'000	20'000	0	40'000 JPY	103.31%	288'906.54	0.04	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	20'000	26'250	0	46'250 JPY	102.16%	330'326.59	0.05	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	23'000	30'000	0	53'000 JPY	99.75%	369'584.51	0.06	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	15'000	18'000	0	33'000 JPY	93.08%	184'739.89	0.03	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	10'000	35'000	15'000	30'000 JPY	90.46%	219'718.92	0.03	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	18'000	50'000	15'000	53'000 JPY	93.41%	346'096.89	0.05	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	20'000	27'000	0	47'000 JPY	94.13%	309'278.60	0.05	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	25'000	30'000	0	55'000 JPY	94.88%	364'801.73	0.06	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	25'000	10'000	0	35'000 JPY	93.34%	228'380.82	0.04	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	22'000	30'000	0	52'000 JPY	92.98%	338'007.20	0.05	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	15'000	45'000	15'000	45'000 JPY	92.52%	291'068.52	0.04	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	30'000	20'000	0	50'000 JPY	90.91%	317'764.20	0.05	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	30'000	40'000	10'000	60'000 JPY	90.52%	379'685.32	0.06	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	21'000	25'000	0	46'000 JPY	92.59%	297'765.04	0.05	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	25'000	35'000	0	60'000 JPY	89.52%	375'503.28	0.06	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	22'000	30'000	0	52'000 JPY	87.81%	319'219.73	0.05	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	37'000	30'000	7'000	60'000 JPY	85.97%	360'608.15	0.06	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	10'000	56'000	5'000	61'000 JPY	85.43%	364'315.43	0.06	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	40'000	20'000	0	60'000 JPY	85.01%	356'572.91	0.05	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	35'000	20'000	0	55'000 JPY	85.87%	330'188.34	0.05	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	35'000	45'000	0	80'000 JPY	85.50%	478'165.45	0.07	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	43'000	27'000	0	70'000 JPY	85.01%	416'011.52	0.06	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	40'000	45'000	0	85'000 JPY	86.03%	511'212.14	0.08	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	40'000	30'000	0	70'000 JPY	85.55%	418'659.03	0.06	a)
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	47'000	40'000	0	87'000 JPY	83.64%	508'734.58	0.08	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	45'000	34'000	0	79'000 JPY	84.69%	467'742.42	0.07	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	40'000	48'000	0	88'000 JPY	84.32%	518'716.34	0.08	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	45'000	30'000	0	75'000 JPY	88.34%	463'207.75	0.07	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	35'000	37'000	0	72'000 JPY	89.61%	451'056.95	0.07	a)
JP1201821NA5	1.1000 % JGB 1.1 09/20/42 182	33'000	48'000	7'500	73'500 JPY	92.29%	474'240.36	0.07	a)
JP1201831P14	1.4000 % JGB 1.4 12/20/42 183	30'000	30'000	0	60'000 JPY	96.71%	405'662.67	0.06	a)
JP1201841P46	1.1000 % JGB 1.1 03/20/43 184	29'500	30'000	0	59'500 JPY	91.80%	381'870.62	0.06	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	15'000	60'000	7'500	67'500 JPY	91.35%	431'095.76	0.07	a)
JP1201861PA6	1.5000 % JGB 1 1/2 09/20/43 186	0	75'000	0	75'000 JPY	97.59%	511'671.45	0.08	a)
JP1201871Q14	1.3000 % JGB 1.3 12/20/43 187	0	65'500	0	65'500 JPY	94.14%	431'061.71	0.07	a)
JP1201881Q46	1.6000 % JGB 1.6 03/20/44 188	0	77'000	0	77'000 JPY	98.64%	531'000.59	0.08	a)
JP1201891Q77	1.9000 % JGB 1.9 06/20/44 189	0	42'000	0	42'000 JPY	103.41%	303'624.94	0.05	a)
JP1300071253	2.3000 % JGB 2.3 05/20/32 7	0	10'000	0	10'000 JPY	112.33%	78'530.46	0.01	a)
JP13000812B5	1.8000 % JGB 1.8 11/22/32 8	0	10'000	0	10'000 JPY	108.82%	76'074.51	0.01	a)
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	7'000	0	0	7'000 JPY	108.10%	52'899.32	0.01	a)
JP13001213B5	2.1000 % JGB 2.1 09/20/33 12	0	15'000	0	15'000 JPY	111.52%	116'948.38	0.02	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	10'000	0	0	10'000 JPY	110.63%	77'340.59	0.01	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	10'000	10'000	0	20'000 JPY	114.20%	159'675.58	0.02	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	15'000	15'000	0	30'000 JPY	115.22%	241'656.83	0.04	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	10'000	15'000	0	25'000 JPY	115.25%	201'422.64	0.03	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	10'000	10'000	0	20'000 JPY	114.43%	160'002.76	0.02	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	15'000	10'000	0	25'000 JPY	113.44%	198'262.68	0.03	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	10'000	15'000	0	25'000 JPY	113.47%	198'323.85	0.03	a)
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	10'000	10'000	0	20'000 JPY	115.61%	161'645.66	0.02	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	9'400	10'000	0	19'400 JPY	113.51%	153'952.21	0.02	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	10'000	10'000	0	20'000 JPY	115.69%	161'757.52	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	15'000	10'000	0	25'000 JPY	115.72%	202'245.83	0.03	a)
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	15'000	20'000	15'000	20'000 JPY	115.73%	161'809.25	0.02	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	10'000	10'000	0	20'000 JPY	113.56%	158'780.73	0.02	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	20'000	20'000	0	40'000 JPY	114.61%	320'508.88	0.05	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	15'000	20'000	0	35'000 JPY	115.79%	283'325.23	0.04	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	20'000	35'000	0	55'000 JPY	115.70%	444'883.16	0.07	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	20'000	35'000	10'000	45'000 JPY	114.24%	359'392.75	0.06	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	12'000	50'000	0	62'000 JPY	112.65%	488'293.24	0.08	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	30'000	30'000	6'000	54'000 JPY	110.99%	419'017.11	0.06	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	30'000	25'000	0	55'000 JPY	112.16%	431'271.58	0.07	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	35'000	30'000	0	65'000 JPY	107.62%	489'058.55	0.08	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	28'000	30'000	0	58'000 JPY	110.26%	447'075.13	0.07	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	36'300	30'000	0	66'300 JPY	106.97%	495'822.30	0.08	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	35'000	37'000	0	72'000 JPY	106.61%	536'622.37	0.08	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	44'500	45'000	10'000	79'500 JPY	104.82%	582'594.15	0.09	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	25'000	20'000	0	45'000 JPY	102.83%	323'484.62	0.05	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	18'500	20'000	0	38'500 JPY	104.18%	280'392.66	0.04	a)
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	15'000	25'000	10'000	30'000 JPY	102.35%	214'664.38	0.03	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	15'000	20'000	0	35'000 JPY	100.66%	246'289.45	0.04	a)
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	15'000	17'000	0	32'000 JPY	100.40%	224'608.45	0.03	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	10'000	15'000	0	25'000 JPY	100.14%	175'024.43	0.03	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	17'000	10'000	0	27'000 JPY	99.88%	188'533.73	0.03	a)
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	10'000	10'000	0	20'000 JPY	96.15%	134'440.69	0.02	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	20'000	10'000	0	30'000 JPY	95.97%	201'281.42	0.03	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	10'000	10'000	0	20'000 JPY	97.45%	136'252.77	0.02	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	10'000	12'000	0	22'000 JPY	93.65%	144'035.07	0.02	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	5'000	15'000	0	20'000 JPY	93.45%	130'658.53	0.02	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	20'000	10'000	0	30'000 JPY	82.49%	173'003.32	0.03	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	12'000	18'250	0	30'250 JPY	73.16%	154'724.58	0.02	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	19'500	25'000	0	44'500 JPY	76.30%	237'373.73	0.04	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	15'500	20'000	0	35'500 JPY	77.64%	192'676.31	0.03	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	12'000	15'000	0	27'000 JPY	80.91%	152'714.94	0.02	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	13'000	15'000	0	28'000 JPY	80.50%	157'586.10	0.02	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	15'000	20'000	0	35'000 JPY	80.11%	196'011.21	0.03	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	15'000	20'000	0	35'000 JPY	79.83%	195'340.77	0.03	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	19'000	20'000	0	39'000 JPY	79.56%	216'918.37	0.03	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	22'000	33'000	11'000	44'000 JPY	77.34%	237'893.41	0.04	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	15'000	10'000	0	25'000 JPY	80.73%	141'093.37	0.02	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	20'000	15'000	0	35'000 JPY	76.53%	187'261.22	0.03	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	10'000	20'000	0	30'000 JPY	72.37%	151'791.08	0.02	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	27'000	15'000	5'000	37'000 JPY	69.94%	180'900.06	0.03	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	17'000	20'000	0	37'000 JPY	69.52%	179'818.82	0.03	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	30'000	25'000	0	55'000 JPY	69.22%	266'140.88	0.04	a)
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	0	44'400	0	44'400 JPY	68.81%	213'572.52	0.03	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	20'000	31'000	0	51'000 JPY	72.39%	258'105.44	0.04	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	38'000	15'000	0	53'000 JPY	71.99%	266'734.00	0.04	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	32'000	32'000	0	64'000 JPY	73.62%	329'413.80	0.05	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	35'000	20'000	0	55'000 JPY	73.29%	281'801.88	0.04	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	35'000	20'000	0	55'000 JPY	72.89%	280'263.85	0.04	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	30'000	35'000	0	65'000 JPY	72.49%	329'421.42	0.05	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	20'000	43'650	0	63'650 JPY	72.22%	321'342.55	0.05	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	20'000	35'000	0	55'000 JPY	78.08%	300'215.96	0.05	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	31'200	35'000	0	66'200 JPY	84.17%	389'531.20	0.06	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	32'500	20'000	0	52'500 JPY	86.10%	316'012.94	0.05	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	25'000	25'000	0	50'000 JPY	90.13%	315'037.69	0.05	a)
JP1300781P48	1.4000 % JGB 1.4 03/20/53 78	30'850	45'000	0	75'850 JPY	85.72%	454'527.21	0.07	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	10'000	45'000	0	55'000 JPY	81.34%	312'770.14	0.05	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	0	51'000	0	51'000 JPY	94.02%	335'207.98	0.05	a)
JP1300811Q17	1.6000 % JGB 1.6 12/20/53 81	0	60'000	0	60'000 JPY	89.50%	375'402.61	0.06	a)
JP1300821Q49	1.8000 % JGB 1.8 03/20/54 82	0	61'000	0	61'000 JPY	93.69%	399'557.59	0.06	a)
JP1300831Q70	2.2000 % JGB 2.2 06/20/54 83	0	47'000	0	47'000 JPY	102.40%	336'448.83	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	10'000	12'000	0	22'000 JPY	109.71%	168'737.38	0.03	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	10'000	25'000	0	35'000 JPY	105.35%	257'765.26	0.04	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	28'000	17'000	20'000	25'000 JPY	104.76%	183'092.10	0.03	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	21'000	20'000	0	41'000 JPY	103.87%	297'728.62	0.05	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	25'000	20'000	5'000	40'000 JPY	98.98%	276'795.24	0.04	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	13'000	15'000	0	28'000 JPY	96.46%	188'817.91	0.03	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	15'000	10'000	0	25'000 JPY	91.56%	160'023.39	0.02	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	15'000	15'000	0	30'000 JPY	84.18%	176'556.17	0.03	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	28'000	20'000	0	48'000 JPY	60.68%	203'617.41	0.03	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	30'000	20'000	5'000	45'000 JPY	71.23%	224'078.18	0.03	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	24'000	30'000	0	54'000 JPY	67.83%	256'054.48	0.04	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	27'000	25'000	0	52'000 JPY	59.60%	216'652.08	0.03	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	45'000	50'500	0	95'500 JPY	58.29%	389'177.11	0.06	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	42'900	43'000	0	85'900 JPY	61.95%	372'023.07	0.06	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	33'000	57'000	0	90'000 JPY	68.29%	429'702.09	0.07	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	15'450	72'000	0	87'450 JPY	74.68%	456'544.66	0.07	a)
JP1400171Q50	2.2000 % JGB 2.2 03/20/64 17	0	28'000	0	28'000 JPY	96.70%	189'289.67	0.03	a)
JP1470011Q24	0.3000 % JGB 0.3 12/20/28 1	0	10'000	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP							67'706'969.19	10.43	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	30'000	0	30'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	6'000	5'000	0	11'000 MXN	104.63%	58'715.53	0.01	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	38'000	27'000	0	65'000 MXN	96.19%	318'961.57	0.05	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	30'000	49'500	0	79'500 MXN	97.54%	395'610.22	0.06	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	25'000	25'000	0	50'000 MXN	92.20%	235'170.86	0.04	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	46'850	29'000	0	75'850 MXN	92.97%	359'744.86	0.06	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	32'500	56'000	0	88'500 MXN	83.40%	376'541.39	0.06	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	10'250	35'500	0	45'750 MXN	89.64%	209'212.81	0.03	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	50'000	31'000	0	81'000 MXN	94.96%	392'376.18	0.06	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	32'650	15'000	0	47'650 MXN	84.48%	205'351.24	0.03	a)
MX0MGO000193	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	9'000	56'000	0	65'000 MXN	95.69%	317'301.25	0.05	a)
MX0MGO0001B0	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	21'000	0	21'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0001C8	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	32'000	55'000	0	87'000 MXN	92.16%	409'033.40	0.06	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	23'200	59'000	0	82'200 MXN	89.48%	375'226.12	0.06	a)
MX0MGO0001E4	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	15'000	48'000	0	63'000 MXN	83.60%	268'694.15	0.04	a)
MX0MGO0001F1	8.5000 % MBONO 8 1/2 03/01/29 M	0	46'000	0	46'000 MXN	97.55%	228'929.92	0.04	a)
MXM5GO000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	0	5'000	0	5'000 MXN	89.86%	22'921.33	0.00	a)
MX							4'173'790.83	0.64	
MYBMI2300024	3.5190 % MGS 3.519 04/20/28 0223	0	320	0	320 MYR	100.20%	77'760.74	0.01	a)
MYBMK2200030	4.5040 % MGS 4.504 04/30/29 0322	0	400	0	400 MYR	104.08%	100'960.83	0.02	a)
MYBML1700020	4.0590 % MGS 4.059 09/30/24 0217	400	0	400	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBML1900018	3.9060 % MGS 3.906 07/15/26 0119	0	600	0	600 MYR	101.07%	147'058.57	0.02	a)
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	500	0	0	500 MYR	100.69%	122'086.82	0.02	a)
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	300	0	0	300 MYR	101.29%	73'692.98	0.01	a)
MYBMO1700040	3.8990 % MGS 3.899 11/16/27 0417	0	600	0	600 MYR	101.48%	147'666.79	0.02	a)
MYBMO1900020	3.8850 % MGS 3.885 08/15/29 0219	0	650	0	650 MYR	101.69%	160'292.35	0.02	a)
MYBMO2000028	2.6320 % MGS 2.632 04/15/31 0220	500	0	0	500 MYR	93.92%	113'885.05	0.02	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	400	0	0	400 MYR	98.94%	95'977.69	0.01	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	200	0	400 MYR	100.94%	97'914.88	0.02	a)
MYBMS1900047	3.8280 % MGS 3.828 07/05/34 0419	500	0	0	500 MYR	100.97%	122'432.40	0.02	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	400	0	0	400 MYR	106.73%	103'529.53	0.02	a)
MYBMX0700034	3.5020 % MGS 3.502 05/31/27 0307	650	0	0	650 MYR	100.42%	158'291.99	0.02	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	500	0	0	500 MYR	104.40%	126'585.43	0.02	a)
MYBMX1100044	4.2320 % MGS 4.232 06/30/31 0411	0	400	0	400 MYR	103.11%	100'018.92	0.02	a)
MYBMX1300040	3.8440 % MGS 3.844 04/15/33 0413	0	400	0	400 MYR	100.55%	97'538.50	0.02	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	300	400	0	700 MYR	108.60%	184'351.16	0.03	a)
MYBMX1800049	4.8930 % MGS 4.893 06/08/38 0418	0	400	0	400 MYR	110.31%	107'005.21	0.02	a)
MYBMY1500043	4.2540 % MGS 4.254 05/31/35 0415	0	345	0	345 MYR	104.00%	87'015.97	0.01	a)
MYBMY1900052	3.7570 % MGS 3.757 05/22/40 0519	200	500	0	700 MYR	97.55%	165'594.52	0.03	a)
MYBMY2200023	4.6960 % MGS 4.696 10/15/42 0222	450	0	0	450 MYR	108.54%	118'449.25	0.02	a)
MYBMZ1300078	4.9350 % MGS 4.935 09/30/43 0713	0	400	0	400 MYR	111.48%	108'139.20	0.02	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	140	0	0	140 MYR	109.02%	37'013.85	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
MYBMZ1800051	4.9210 % MGS 4.921 07/06/48 0518	205	200	0	405 MYR	112.04%	110'041.94	0.02	a)
MYBMZ2000016	4.0650 % MGS 4.065 06/15/50 0120	355	275	0	630 MYR	98.39%	150'318.44	0.02	a)
MYBMZ2300010	4.4570 % MGS 4.457 03/31/53 0123	0	400	0	400 MYR	104.49%	101'363.41	0.02	a)
MY							3'014'986.42	0.46	
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	175	210	0	385 EUR	114.89%	493'656.95	0.08	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	140	150	0	290 EUR	110.70%	358'284.41	0.06	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	193	290	100	383 EUR	114.66%	490'109.37	0.08	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	190	150	0	340 EUR	101.28%	384'312.85	0.06	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	222	205	0	427 EUR	101.10%	481'793.93	0.07	a)
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	98	320	418	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	210	140	0	350 EUR	97.22%	379'757.15	0.06	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	205	195	0	400 EUR	96.50%	430'793.96	0.07	a)
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	217	190	0	407 EUR	95.18%	432'337.00	0.07	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	100	180	0	280 EUR	91.54%	286'056.12	0.04	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	182	160	0	342 EUR	73.25%	279'586.39	0.04	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	157	175	0	332 EUR	88.25%	326'990.47	0.05	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	150	155	0	305 EUR	86.01%	292'773.04	0.05	a)
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	120	195	0	315 EUR	70.76%	248'760.07	0.04	a)
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	140	230	0	370 EUR	91.43%	377'548.49	0.06	a)
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	150	115	100	165 EUR	97.17%	178'934.46	0.03	a)
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	165	140	0	305 EUR	87.28%	297'096.05	0.05	a)
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	85	215	0	300 EUR	86.28%	288'877.48	0.04	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	80	215	0	295 EUR	101.04%	332'657.75	0.05	a)
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	75	185	0	260 EUR	101.61%	294'843.87	0.05	a)
NL0015001RG8	3.2500 % NETHER 3 1/4 01/15/44	0	210	0	210 EUR	108.39%	254'021.67	0.04	a)
NL0015001XZ6	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/34	0	215	0	215 EUR	100.63%	241'461.69	0.04	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	175	170	0	345 EUR	95.45%	367'516.91	0.06	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	218	185	0	403 EUR	49.42%	222'274.73	0.03	a)
NL							7'740'444.81	1.19	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	600	0	600	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	700	350	0	1'050 NOK	97.08%	96'782.06	0.01	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	450	500	0	950 NOK	96.29%	86'849.47	0.01	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	500	650	0	1'150 NOK	95.67%	104'456.62	0.02	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	350	900	0	1'250 NOK	93.16%	110'560.97	0.02	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	530	600	0	1'130 NOK	90.01%	96'569.77	0.01	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	600	500	0	1'100 NOK	87.59%	91'471.28	0.01	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	350	600	0	950 NOK	92.30%	83'252.46	0.01	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	0	370	0	370 NOK	101.96%	35'816.69	0.01	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	400	1'000	0	1'400 NOK	97.67%	129'825.64	0.02	a)
NO0013148338	3.6250 % NGB 3 5/8 04/13/34 487	0	700	0	700 NOK	102.22%	67'936.75	0.01	a)
NO							903'521.71	0.14	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	80	0	80	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	80	150	0	230 NZD	101.97%	149'225.75	0.02	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	80	140	0	220 NZD	96.76%	135'437.30	0.02	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	120	200	0	320 NZD	94.91%	193'232.08	0.03	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	60	95	0	155 NZD	82.97%	81'821.32	0.01	a)
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	60	90	0	150 NZD	94.79%	90'461.78	0.01	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	150	190	0	340 NZD	88.40%	191'238.61	0.03	a)
NZGOVDT530C2	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/30 0530	100	50	0	150 NZD	102.96%	98'264.66	0.02	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	60	140	0	200 NZD	85.44%	108'718.99	0.02	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	150	50	0	200 NZD	86.17%	109'652.71	0.02	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	40	110	0	150 NZD	99.89%	95'332.31	0.01	a)
NZGOVDT535C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/35 0535	0	110	0	110 NZD	101.18%	70'815.78	0.01	a)
NZGOVDT536C9	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/36 0536	0	170	0	170 NZD	98.15%	106'157.18	0.02	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	40	75	0	115 NZD	65.75%	48'108.70	0.01	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	50	80	0	130 NZD	68.74%	56'859.10	0.01	a)
NZGOVDT554C2	5.0000 % NZGB 5 05/15/54 0554	0	95	0	95 NZD	101.80%	61'532.21	0.01	a)
NZ							1'596'858.48	0.25	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	600	0	0	600 PLN	103.43%	161'765.24	0.02	a)
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	400	1'900	0	2'300 PLN	93.53%	560'746.03	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	220	0	220	0 PLN	0.00%	0.00		
PL0000108866	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/26 0726	300	300	0	600 PLN	96.23%	150'504.39	0.02	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	750	300	0	1'050 PLN	94.15%	257'689.70	0.04	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	260	1'600	0	1'860 PLN	90.53%	438'927.61	0.07	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	750	0	750	0 PLN	0.00%	0.00		
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	630	650	0	1'280 PLN	81.01%	270'293.77	0.04	a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	850	900	0	1'750 PLN	91.34%	416'664.49	0.06	a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	450	2'100	0	2'550 PLN	79.36%	527'508.27	0.08	a)
PL0000115283	0.0000 % POLGB 0 10/25/25 1025	0	1'000	0	1'000 PLN	95.53%	249'015.98	0.04	a)
PL							3'033'115.48	0.47	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	750	200	0	950 SEK	116.03%	108'742.13	0.02	a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	400	460	0	860 SEK	102.71%	87'143.66	0.01	a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	750	0	750	0 SEK	0.00%	0.00		
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	950	600	0	1'550 SEK	98.58%	150'733.78	0.02	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	450	1'130	0	1'580 SEK	96.80%	150'882.94	0.02	a)
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	750	900	0	1'650 SEK	95.24%	155'028.32	0.02	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	750	500	0	1'250 SEK	89.58%	110'469.74	0.02	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	500	780	0	1'280 SEK	98.38%	124'225.64	0.02	a)
SE							887'226.21	0.14	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	125	0	125	0 SGD	0.00%	0.00		
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	90	120	0	210 SGD	101.21%	165'788.61	0.03	a)
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	75	120	0	195 SGD	99.48%	151'315.13	0.02	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	130	50	0	180 SGD	95.72%	134'396.26	0.02	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	75	50	0	125 SGD	100.67%	98'157.18	0.02	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	65	60	0	125 SGD	100.94%	98'420.44	0.02	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	75	90	0	165 SGD	105.96%	136'375.97	0.02	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	100	75	0	175 SGD	101.67%	138'785.10	0.02	a)
SG7160932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	165	0	0	165 SGD	102.49%	131'909.91	0.02	a)
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	100	60	0	160 SGD	101.88%	127'151.33	0.02	a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	65	150	0	215 SGD	97.59%	163'664.98	0.03	a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	50	90	0	140 SGD	96.23%	105'087.36	0.02	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	70	50	0	120 SGD	85.46%	79'993.76	0.01	a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	50	90	0	140 SGD	97.70%	106'692.67	0.02	a)
SGXF33080817	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/27	0	80	0	80 SGD	101.28%	63'201.25	0.01	a)
SGXF45447632	3.0000 % SIGB 3 04/01/29	0	50	0	50 SGD	102.29%	39'894.70	0.01	a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	30	100	0	130 SGD	100.08%	101'485.18	0.02	a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	30	100	0	130 SGD	109.87%	111'412.64	0.02	a)
SGXF51035222	2.8750 % SIGB 2 7/8 08/01/28	0	140	0	140 SGD	101.53%	110'875.19	0.02	a)
SGXF75438295	3.3750 % SIGB 3 3/8 05/01/34	0	120	0	120 SGD	106.40%	99'594.38	0.02	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	70	50	0	120 SGD	94.16%	88'137.29	0.01	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	50	60	0	110 SGD	84.84%	72'795.63	0.01	a)
SGXPK17B11U8	3.2500 % SIGB 3 1/4 06/01/54	0	50	0	50 SGD	112.30%	43'798.75	0.01	a)
SG							2'368'933.71	0.36	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	65	100	0	165 USD	102.84%	169'692.19	0.03	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	200	0	0	200 USD	107.38%	214'750.00	0.03	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	70	100	0	170 USD	106.28%	180'678.13	0.03	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	80	50	0	130 USD	113.22%	147'184.38	0.02	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	77	100	0	177 USD	109.91%	194'534.06	0.03	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	125	100	0	225 USD	107.06%	240'890.63	0.04	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	100	100	50	150 USD	111.66%	167'484.38	0.03	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	100	100	0	200 USD	105.30%	210'593.76	0.03	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	100	60	0	160 USD	106.47%	170'350.00	0.03	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	80	110	0	190 USD	95.39%	181'242.18	0.03	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	150	135	0	285 USD	103.33%	294'485.14	0.05	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	200	380	260	320 USD	106.03%	339'300.00	0.05	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	100	200	0	300 USD	104.59%	313'781.25	0.05	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	150	200	0	350 USD	107.41%	375'921.88	0.06	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	100	150	0	250 USD	104.47%	261'171.88	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	150	90	0	240 USD	98.50%	236'400.00	0.04	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	140	100	0	240 USD	102.91%	246'975.00	0.04	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	150	100	0	250 USD	108.88%	272'187.50	0.04	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	118	150	0	268 USD	104.28%	279'473.75	0.04	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	152	110	30	232 USD	96.38%	223'590.00	0.03	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	140	110	0	250 USD	88.31%	220'781.25	0.03	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	150	160	0	310 USD	88.02%	272'848.42	0.04	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	170	170	0	340 USD	85.94%	292'187.50	0.04	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	200	185	30	355 USD	82.36%	292'375.80	0.05	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	250	310	0	560 USD	81.98%	459'112.53	0.07	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	230	195	0	425 USD	86.53%	367'757.81	0.06	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	320	340	0	660 USD	83.02%	547'903.09	0.08	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	255	250	0	505 USD	92.55%	467'361.74	0.07	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	318	240	50	508 USD	94.08%	477'916.85	0.07	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	230	305	0	535 USD	92.25%	493'537.50	0.08	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	250	200	0	450 USD	88.83%	399'726.54	0.06	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	340	255	0	595 USD	85.23%	507'144.56	0.08	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	280	270	0	550 USD	83.41%	458'734.38	0.07	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	340	335	0	675 USD	76.41%	515'742.19	0.08	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	183	160	0	343 USD	83.14%	285'172.33	0.04	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	210	290	0	500 USD	81.28%	406'406.25	0.06	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	130	160	0	290 USD	82.94%	240'518.75	0.04	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	280	335	0	615 USD	75.59%	464'901.56	0.07	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	280	310	0	590 USD	75.36%	444'620.34	0.07	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	352	360	0	712 USD	71.56%	509'525.00	0.08	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	140	150	0	290 USD	80.38%	233'087.50	0.04	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	360	280	0	640 USD	81.92%	524'300.03	0.08	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	250	270	0	520 USD	81.81%	425'425.00	0.07	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	350	350	0	700 USD	78.02%	546'109.34	0.08	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	395	310	0	705 USD	77.86%	548'908.63	0.08	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	300	615	100	815 USD	81.31%	662'696.88	0.10	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	450	415	0	865 USD	83.05%	718'355.51	0.11	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	464	665	150	979 USD	81.06%	793'601.88	0.12	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	485	500	0	985 USD	86.63%	853'256.25	0.13	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	510	685	150	1'045 USD	80.94%	845'796.88	0.13	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	490	810	270	1'030 USD	78.94%	813'056.25	0.13	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	490	460	0	950 USD	69.28%	658'171.88	0.10	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	444	415	0	859 USD	71.08%	610'561.05	0.09	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	555	565	0	1'120 USD	65.16%	729'750.00	0.11	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	645	710	0	1'355 USD	53.50%	724'925.00	0.11	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	780	660	0	1'440 USD	55.09%	793'350.00	0.12	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	480	580	0	1'060 USD	65.47%	693'968.75	0.11	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	510	355	0	865 USD	66.03%	571'170.31	0.09	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	720	750	0	1'470 USD	58.78%	864'084.38	0.13	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	630	580	0	1'210 USD	67.83%	820'720.25	0.13	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	805	785	0	1'590 USD	62.64%	995'985.86	0.15	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	714	735	0	1'449 USD	73.31%	1'062'298.13	0.16	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	850	850	50	1'650 USD	70.56%	1'164'281.25	0.18	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	618	640	0	1'258 USD	77.50%	974'950.00	0.15	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	750	830	0	1'580 USD	64.41%	1'017'618.75	0.16	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	810	820	0	1'630 USD	70.88%	1'155'262.50	0.18	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	745	780	0	1'525 USD	62.28%	949'789.06	0.15	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	680	685	0	1'365 USD	73.52%	1'003'488.21	0.15	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	680	665	0	1'345 USD	68.19%	917'121.88	0.14	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	536	525	0	1'061 USD	77.88%	826'253.75	0.13	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	649	675	0	1'324 USD	78.31%	1'036'857.50	0.16	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	455	505	0	960 USD	88.91%	853'500.00	0.13	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	690	625	100	1'215 USD	80.38%	976'556.25	0.15	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	407	440	0	847 USD	90.23%	764'285.20	0.12	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	685	585	0	1'270 USD	97.31%	1'235'868.75	0.19	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	407	410	0	817 USD	98.41%	803'979.06	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	688	530	0	1'218 USD	90.92%	1'107'428.50	0.17	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	410	425	0	835 USD	96.50%	805'775.00	0.12	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	680	585	0	1'265 USD	91.00%	1'151'150.00	0.18	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	450	370	0	820 USD	96.28%	789'506.25	0.12	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	0	1'365	0	1'365 USD	99.59%	1'359'454.69	0.21	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	75	950	100	925 USD	102.84%	951'304.69	0.15	a)
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	0	1'445	0	1'445 USD	110.47%	1'596'273.44	0.25	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	0	925	0	925 USD	107.89%	997'988.24	0.15	a)
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	0	1'520	0	1'520 USD	101.92%	1'549'212.58	0.24	a)
US912810TZ12	4.5000 % T 4 1/2 02/15/44	0	895	0	895 USD	104.34%	933'876.56	0.14	a)
US912810UA42	4.6250 % T 4 5/8 05/15/54	0	1'520	0	1'520 USD	108.47%	1'648'725.00	0.25	a)
US912810UB25	4.6250 % T 4 5/8 05/15/44	0	925	0	925 USD	106.00%	980'500.00	0.15	a)
US912810UC08	4.2500 % T 4 1/4 08/15/54	0	550	0	550 USD	102.11%	561'601.59	0.09	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	650	510	0	1'160 USD	96.08%	1'114'506.19	0.17	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	500	450	0	950 USD	96.38%	915'562.50	0.14	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	540	450	0	990 USD	96.09%	951'328.13	0.15	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	270	0	270	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	320	0	320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	653	635	0	1'288 USD	97.36%	1'253'988.81	0.19	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	695	675	0	1'370 USD	97.59%	1'337'034.38	0.21	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	0	415	415	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	740	660	0	1'400 USD	97.44%	1'364'125.00	0.21	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	220	180	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	240	235	0	475 USD	99.02%	470'324.20	0.07	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	200	210	0	410 USD	99.00%	405'900.00	0.06	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	646	665	0	1'311 USD	98.23%	1'287'852.72	0.20	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	250	190	0	440 USD	98.83%	434'843.73	0.07	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	250	150	0	400 USD	98.48%	393'937.52	0.06	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	280	290	0	570 USD	98.47%	561'271.88	0.09	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	650	635	0	1'285 USD	96.16%	1'235'607.81	0.19	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	300	280	0	580 USD	98.22%	569'668.75	0.09	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	250	220	0	470 USD	97.80%	459'645.34	0.07	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	210	150	0	360 USD	97.91%	352'462.50	0.05	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	530	660	130	1'060 USD	94.89%	1'005'840.57	0.15	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	260	200	0	460 USD	97.44%	448'212.50	0.07	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	250	290	0	540 USD	96.92%	523'378.15	0.08	a)
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	1'080	0	1'080	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	595	470	1'065	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	631	615	0	1'246 USD	98.17%	1'223'221.62	0.19	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	550	630	0	1'180 USD	97.08%	1'145'521.82	0.18	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	550	640	0	1'190 USD	96.69%	1'150'581.25	0.18	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	550	600	0	1'150 USD	96.66%	1'111'546.88	0.17	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	495	500	0	995 USD	96.92%	964'372.71	0.15	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	595	605	0	1'200 USD	96.95%	1'163'437.44	0.18	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	550	70	620	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	150	170	320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	200	190	390	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	232	210	0	442 USD	96.81%	427'911.25	0.07	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	500	520	30	990 USD	91.45%	905'385.89	0.14	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	265	170	0	435 USD	95.80%	416'716.43	0.06	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	200	130	0	330 USD	96.16%	317'315.63	0.05	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	250	255	0	505 USD	95.97%	484'642.19	0.07	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	365	410	0	775 USD	91.61%	709'972.70	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	250	200	0	450 USD	95.84%	431'296.88	0.07	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	240	290	0	530 USD	96.02%	508'882.79	0.08	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	340	0	340	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	828	855	0	1'683 USD	95.31%	1'604'109.38	0.25	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	635	680	30	1'285 USD	89.77%	1'153'488.22	0.18	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	148	175	0	323 USD	94.31%	304'440.75	0.05	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	220	275	0	495 USD	92.95%	460'117.94	0.07	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	400	200	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	275	235	510	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	345	350	0	695 USD	92.44%	642'440.63	0.10	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	900	930	60	1'770 USD	84.91%	1'502'840.63	0.23	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	319	355	0	674 USD	92.22%	621'554.38	0.10	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	600	160	760	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	400	430	0	830 USD	92.00%	763'600.00	0.12	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	550	250	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	490	350	840	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	470	505	0	975 USD	91.44%	891'515.63	0.14	a)
US912828ZAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	1'335	950	0	2'285 USD	84.27%	1'925'469.42	0.30	a)
US912828ZAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	370	470	0	840 USD	91.56%	769'125.00	0.12	a)
US912828ZAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	490	350	500	340 USD	96.59%	328'418.75	0.05	a)
US912828ZAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	520	535	0	1'055 USD	90.98%	959'885.21	0.15	a)
US912828ZAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	565	600	0	1'165 USD	96.38%	1'122'768.75	0.17	a)
US912828ZAN80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	580	660	0	1'240 USD	96.11%	1'191'756.31	0.18	a)
US912828ZAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	508	510	0	1'018 USD	91.08%	926'993.11	0.14	a)
US912828ZAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	1'268	1'130	0	2'398 USD	85.11%	2'040'922.93	0.31	a)
US912828ZAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	495	630	0	1'125 USD	91.22%	1'026'210.94	0.16	a)
US912828ZAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	555	595	0	1'150 USD	96.05%	1'104'539.12	0.17	a)
US912828ZBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	647	630	0	1'277 USD	91.03%	1'162'469.06	0.18	a)
US912828ZBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	595	620	0	1'215 USD	95.78%	1'163'742.19	0.18	a)
US912828ZBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	673	675	0	1'348 USD	95.55%	1'287'971.94	0.20	a)
US912828ZBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	662	650	0	1'312 USD	91.19%	1'196'380.00	0.18	a)
US912828ZBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	1'136	1'165	0	2'301 USD	85.98%	1'978'500.58	0.30	a)
US912828ZBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	668	680	0	1'348 USD	92.17%	1'242'476.94	0.19	a)
US912828ZBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	650	660	0	1'310 USD	95.50%	1'251'050.00	0.19	a)
US912828ZBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	610	595	0	1'205 USD	92.41%	1'113'495.31	0.17	a)
US912828ZBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	612	600	0	1'212 USD	95.64%	1'159'164.31	0.18	a)
US912828ZBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	609	630	0	1'239 USD	95.44%	1'182'470.63	0.18	a)
US912828ZBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	670	655	0	1'325 USD	92.22%	1'221'898.44	0.19	a)
US912828ZCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	1'125	1'095	0	2'220 USD	88.16%	1'957'068.75	0.30	a)
US912828ZCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	670	655	0	1'325 USD	92.03%	1'219'414.06	0.19	a)
US912828ZCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	635	650	0	1'285 USD	95.25%	1'223'962.50	0.19	a)
US912828ZCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	620	605	0	1'225 USD	91.88%	1'125'468.75	0.17	a)
US912828ZCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	600	560	0	1'160 USD	95.27%	1'105'081.19	0.17	a)
US912828ZCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	750	530	0	1'280 USD	94.63%	1'211'200.00	0.19	a)
US912828ZCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	658	620	0	1'278 USD	90.80%	1'160'384.13	0.18	a)
US912828ZCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	1'233	1'300	0	2'533 USD	85.39%	2'162'944.40	0.33	a)
US912828ZCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	650	670	0	1'320 USD	91.08%	1'202'231.18	0.19	a)
US912828ZCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	650	660	0	1'310 USD	94.66%	1'239'996.88	0.19	a)
US912828ZCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	656	670	0	1'326 USD	91.38%	1'211'632.50	0.19	a)
US912828ZCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	650	600	0	1'250 USD	94.72%	1'183'984.38	0.18	a)
US912828ZDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	650	575	0	1'225 USD	91.69%	1'123'171.88	0.17	a)
US912828ZDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	620	690	0	1'310 USD	94.98%	1'244'295.38	0.19	a)
US912828ZDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	648	0	648	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	1'200	1'225	50	2'375 USD	85.63%	2'033'593.75	0.31	a)
US912828ZDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	635	700	0	1'335 USD	95.09%	1'269'501.56	0.20	a)
US912828ZDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	625	640	0	1'265 USD	92.00%	1'163'800.00	0.18	a)
US912828ZDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	585	0	585	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	650	595	50	1'195 USD	91.41%	1'092'304.69	0.17	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	643	560	0	1'203 USD	94.95%	1'142'286.03	0.18	a)
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	560	0	560	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	570	565	0	1'135 USD	92.72%	1'052'357.81	0.16	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	1'135	1'110	0	2'245 USD	88.31%	1'982'615.63	0.31	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	625	0	625	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	550	570	0	1'120 USD	93.09%	1'042'650.00	0.16	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	600	580	0	1'180 USD	96.03%	1'133'168.75	0.17	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	506	510	0	1'016 USD	94.98%	965'041.30	0.15	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	550	545	0	1'095 USD	97.44%	1'066'940.63	0.16	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	555	0	555	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	475	515	0	990 USD	97.02%	960'454.64	0.15	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	527	555	0	1'082 USD	97.94%	1'059'683.75	0.16	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	1'100	1'305	150	2'255 USD	94.56%	2'132'384.38	0.33	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	460	90	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CES61	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	455	470	0	925 USD	96.42%	891'902.39	0.14	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	520	545	0	1'065 USD	97.56%	1'039'040.63	0.16	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	535	280	815	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	431	410	0	841 USD	98.55%	828'779.26	0.13	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	506	510	0	1'016 USD	99.16%	1'007'427.50	0.16	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	465	330	795	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	495	500	0	995 USD	97.77%	972'767.92	0.15	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	400	505	0	905 USD	95.75%	866'537.50	0.13	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	452	320	772	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	1'067	1'100	0	2'167 USD	93.45%	2'025'129.11	0.31	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	485	500	0	985 USD	98.77%	972'841.36	0.15	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	400	380	0	780 USD	97.92%	763'790.66	0.12	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	442	435	0	877 USD	99.53%	872'889.06	0.13	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	390	450	30	810 USD	101.28%	820'378.13	0.13	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	476	490	0	966 USD	101.59%	981'395.63	0.15	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	457	480	0	937 USD	100.28%	939'635.31	0.14	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	378	370	0	748 USD	101.88%	762'025.00	0.12	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	275	670	0	945 USD	101.59%	960'060.94	0.15	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	1'068	1'050	0	2'118 USD	102.88%	2'178'892.50	0.34	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	440	500	0	940 USD	100.63%	945'875.00	0.15	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	454	0	454	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	400	380	30	750 USD	101.31%	759'843.75	0.12	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	465	505	0	970 USD	100.88%	978'487.50	0.15	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	434	505	0	939 USD	100.14%	940'320.42	0.14	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	379	370	0	749 USD	101.31%	758'830.63	0.12	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	465	455	0	920 USD	100.94%	928'625.00	0.14	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	501	0	501	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	430	460	0	890 USD	100.05%	890'417.23	0.14	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	453	0	453	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	465	455	0	920 USD	99.78%	917'987.50	0.14	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	380	420	0	800 USD	99.50%	796'000.00	0.12	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	432	460	0	892 USD	100.27%	894'369.33	0.14	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	1'188	1'105	100	2'193 USD	98.27%	2'154'965.05	0.33	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	453	0	453	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	491	400	0	891 USD	101.38%	903'251.25	0.14	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	379	420	0	799 USD	101.92%	814'355.82	0.13	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	433	480	0	913 USD	101.20%	923'984.49	0.14	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	350	400	0	750 USD	100.06%	750'468.75	0.12	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	465	455	0	920 USD	100.20%	921'868.70	0.14	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	506	175	681	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	450	440	0	890 USD	99.98%	889'860.98	0.14	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	275	250	525	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	380	425	30	775 USD	99.45%	770'761.68	0.12	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	465	430	0	895 USD	99.77%	892'902.30	0.14	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	430	410	0	840 USD	99.84%	838'687.50	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	1'200	915	0	2'115 USD	97.23%	2'056'507.14	0.32	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	350	420	770	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	500	420	0	920 USD	100.16%	921'437.50	0.14	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	350	420	0	770 USD	100.67%	775'173.48	0.12	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	430	460	0	890 USD	100.67%	895'979.73	0.14	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	400	400	0	800 USD	100.66%	805'250.00	0.12	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	465	480	0	945 USD	101.50%	959'175.00	0.15	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	455	320	775	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	430	510	0	940 USD	101.39%	953'071.83	0.15	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	455	320	775	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	465	430	0	895 USD	101.95%	912'480.42	0.14	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	0	825	50	775 USD	101.95%	790'136.68	0.12	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	0	2'360	0	2'360 USD	100.83%	2'379'543.63	0.37	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	200	725	0	925 USD	101.25%	936'562.50	0.14	a)
US91282CHV63	5.0000 % T 5 08/31/25	0	930	0	930 USD	100.83%	937'701.52	0.14	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	0	770	0	770 USD	102.61%	790'092.23	0.12	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	0	985	0	985 USD	102.89%	1'013'472.61	0.16	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	0	960	0	960 USD	101.80%	977'250.05	0.15	a)
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	0	830	0	830 USD	105.31%	874'093.75	0.13	a)
US91282CIA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	0	1'125	0	1'125 USD	103.88%	1'168'593.75	0.18	a)
US91282CIB81	5.0000 % T 5 09/30/25	0	1'040	0	1'040 USD	100.97%	1'050'075.00	0.16	a)
US91282CIC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	0	1'000	0	1'000 USD	101.91%	1'019'062.50	0.16	a)
US91282CIE21	5.0000 % T 5 10/31/25	0	1'140	0	1'140 USD	101.09%	1'152'468.75	0.18	a)
US91282CJF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	0	1'110	0	1'110 USD	104.89%	1'164'285.88	0.18	a)
US91282CJG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	0	800	0	800 USD	106.72%	853'750.00	0.13	a)
US91282CJI18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	0	2'510	0	2'510 USD	105.61%	2'650'795.44	0.41	a)
US91282CJL80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	0	1'065	0	1'065 USD	101.98%	1'086'133.65	0.17	a)
US91282CJL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	0	1'100	0	1'100 USD	101.09%	1'112'031.25	0.17	a)
US91282CJM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	0	820	0	820 USD	104.02%	852'928.08	0.13	a)
US91282CJN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	0	1'175	0	1'175 USD	103.06%	1'210'984.38	0.19	a)
US91282CJP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	0	1'120	0	1'120 USD	101.58%	1'137'674.94	0.18	a)
US91282CJQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	0	890	0	890 USD	100.59%	895'284.38	0.14	a)
US91282CJR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	0	1'270	0	1'270 USD	100.69%	1'278'731.25	0.20	a)
US91282CJS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	0	1'220	0	1'220 USD	100.45%	1'225'528.06	0.19	a)
US91282CJT99	4.0000 % T 4 01/15/27	0	1'160	0	1'160 USD	100.83%	1'169'606.19	0.18	a)
US91282CJV46	4.2500 % T 4 1/4 01/31/26	0	1'285	0	1'285 USD	100.53%	1'291'826.56	0.20	a)
US91282CJW29	4.0000 % T 4 01/31/29	0	1'355	0	1'355 USD	101.70%	1'378'077.28	0.21	a)
US91282CJX02	4.0000 % T 4 01/31/31	0	910	0	910 USD	101.97%	927'915.63	0.14	a)
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	2'565	0	2'565 USD	101.73%	2'609'486.85	0.40	a)
US91282CKA89	4.1250 % T 4 1/8 02/15/27	0	1'200	0	1'200 USD	101.16%	1'213'875.00	0.19	a)
US91282CKB62	4.6250 % T 4 5/8 02/28/26	0	1'345	0	1'345 USD	101.11%	1'359'921.16	0.21	a)
US91282CKC46	4.2500 % T 4 1/4 02/28/31	0	920	0	920 USD	103.41%	951'337.50	0.15	a)
US91282CKD29	4.2500 % T 4 1/4 02/28/29	0	1'370	0	1'370 USD	102.78%	1'408'103.13	0.22	a)
US91282CKE02	4.2500 % T 4 1/4 03/15/27	0	1'260	0	1'260 USD	101.55%	1'279'490.69	0.20	a)
US91282CKF76	4.1250 % T 4 1/8 03/31/31	0	965	0	965 USD	102.72%	991'235.94	0.15	a)
US91282CKG59	4.1250 % T 4 1/8 03/31/29	0	1'465	0	1'465 USD	102.28%	1'498'420.31	0.23	a)
US91282CKH33	4.5000 % T 4 1/2 03/31/26	0	1'470	0	1'470 USD	101.05%	1'485'389.14	0.23	a)
US91282CKJ98	4.5000 % T 4 1/2 04/15/27	0	1'340	0	1'340 USD	102.19%	1'369'312.50	0.21	a)
US91282CKK61	4.8750 % T 4 7/8 04/30/26	0	1'500	0	1'500 USD	101.70%	1'525'546.80	0.23	a)
US91282CKN01	4.6250 % T 4 5/8 04/30/31	0	960	0	960 USD	105.66%	1'014'300.00	0.16	a)
US91282CKP58	4.6250 % T 4 5/8 04/30/29	0	1'530	0	1'530 USD	104.42%	1'597'654.76	0.25	a)
US91282CKQ32	4.3750 % T 4 3/8 05/15/34	0	2'640	0	2'640 USD	104.73%	2'764'987.63	0.43	a)
US91282CKR15	4.5000 % T 4 1/2 05/15/27	0	1'260	0	1'260 USD	102.25%	1'288'350.00	0.20	a)
US91282CKS97	4.8750 % T 4 7/8 05/31/26	0	1'475	0	1'475 USD	101.84%	1'502'195.31	0.23	a)
US91282CKT70	4.5000 % T 4 1/2 05/31/29	0	1'510	0	1'510 USD	104.00%	1'570'400.00	0.24	a)
US91282CKU44	4.6250 % T 4 5/8 05/31/31	0	1'000	0	1'000 USD	105.67%	1'056'718.80	0.16	a)
US91282CKV27	4.6250 % T 4 5/8 06/15/27	0	1'300	0	1'300 USD	102.70%	1'335'140.56	0.21	a)
US91282CKW00	4.2500 % T 4 1/4 06/30/31	0	950	0	950 USD	103.53%	983'546.88	0.15	a)
US91282CKX82	4.2500 % T 4 1/4 06/30/29	0	1'525	0	1'525 USD	102.94%	1'569'796.88	0.24	a)
US91282CKY65	4.6250 % T 4 5/8 06/30/26	0	1'450	0	1'450 USD	101.53%	1'472'203.13	0.23	a)
US91282CKZ31	4.3750 % T 4 3/8 07/15/27	0	1'275	0	1'275 USD	102.09%	1'301'695.31	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 30.09.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CLB53	4.3750 % T 4 3/8 07/31/26	0	1'500	0	1'500 USD	101.20%	1'518'046.80	0.23	a)
US91282CLC37	4.0000 % T 4 07/31/29	0	1'550	0	1'550 USD	101.91%	1'579'546.88	0.24	a)
US91282CLD10	4.1250 % T 4 1/8 07/31/31	0	975	0	975 USD	102.80%	1'002'269.58	0.15	a)
US91282CLF67	3.8750 % T 3 7/8 08/15/34	0	900	0	900 USD	100.69%	906'187.50	0.14	a)
US91282CLG41	3.7500 % T 3 3/4 08/15/27	0	1'325	0	1'325 USD	100.47%	1'331'210.94	0.20	a)
US							266'906'287.32	41.10	

Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

							62'329'960.68	9.60	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							62'329'960.68	9.60	
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	105'467	290'365	7'404	388'427 CNY	1'123.06	62'329'960.68	9.60	a)
CH							62'329'960.68	9.60	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte									
CAD/USD	Verfall 08.11.2023		75'000	102'578	USD/CAD		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 13.11.2023		90'593	100'000	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 13.11.2023		333'977	300'000	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 13.11.2023		187'164	180'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.11.2023		44'276	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.11.2023		110'413	120'000	EUR/USD		0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 06.12.2023		110'794	150'000	USD/CAD		0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 19.12.2023		37'394	50'000	USD/CAD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 27.12.2023		658'501	600'000	USD/EUR		0.00	0.00	
JPY/USD	Verfall 27.12.2023		313'389	45'000'000	USD/JPY		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.01.2024		323'001	300'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		119'573	100'000	USD/CHF		0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 22.03.2024		200'000	271'301	USD/CAD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 26.03.2024		299'092	220'000	CAD/USD		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 08.05.2024		7'547'650	950'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 08.05.2024		5'415'561	4'900'000	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 08.05.2024		378'009	250'000	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 08.05.2024		3'006'761	160'000	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 08.05.2024		3'336'136	3'250'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 16.05.2024		10'383'387	1'300'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 29.05.2024		168'611	170'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.05.2024		347'471	380'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 03.07.2024		12'998'619	1'600'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 05.08.2024		2'350'000	2'171'804	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.08.2024		311'393	400'000	GBP/USD		0.00	0.00	
JPY/USD	Verfall 05.08.2024		200'000	30'080'320	USD/JPY		0.00	0.00	
USD/CNY	Verfall 05.08.2024		12'281'463	1'700'000	CNY/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 09.08.2024		137'264	100'000	CAD/USD		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 27.08.2024		13'413'816	1'600'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.08.2024		398'974	250'000	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 27.08.2024		308'828'374	1'800'000	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.08.2024		7'350'000	6'264'736	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.08.2024		349'484	200'000	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.08.2024		4'697'894	4'450'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 28.08.2024		300'000	268'375	USD/EUR		0.00	0.00	
NZD/USD	Verfall 28.08.2024		100'000	161'156	USD/NZD		0.00	0.00	
JPY/USD	Verfall 28.08.2024		150'000	21'771'930	USD/JPY		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.09.2024		1'384'254	1'300'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.09.2024		215'238	240'000	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 04.09.2024		406'139	95'000	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.09.2024		2'593'144	2'200'000	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 04.09.2024		5'846'366	700'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 04.09.2024		3'241'311	140'000	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.09.2024		65'207'103	380'000	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 04.09.2024		178'974	95'000	NZD/CHF		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 16.09.2024		407'830	300'000	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/CNY	Verfall 19.09.2024		12'120'813	1'700'000	CNY/USD		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

DKK/CHF	Verfall 02.11.2023		334'175	2'577'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023		1'463'021	2'483'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		13'518'184	2'201'569'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		4'721'285	4'241'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023		6'829'117	54'493'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		47'268'202	51'834'000	CHF/USD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.11.2023		285'615	1'191'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.11.2023		181'845	2'120'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023		1'974'395	2'926'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.11.2023		249'311	455'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.11.2023		200'527	2'386'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		31'424'354	32'507'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.11.2023		475'294	2'277'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.11.2023		441'549	660'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		12'520	13'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.11.2023		2'000	1'169	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 02.11.2023		70'000	8'780	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.11.2023		3'000	2'013	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.11.2023		2'665'000	16'374	JPY/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		1'833	2'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'000	4'444	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		7'971	12'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		87'533	96'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		6'110	49'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		2'000	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		3'223	25'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.11.2023		1'458	7'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		430'532	448'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		47'680	43'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		41'035	6'663'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		34'000	32'304	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		57'000	7'019	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		3'000	1'981	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'000	4'389	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		62'998	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		2'324'000	14'012	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		1'831	15'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		3'824	639'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		8'522	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		24'000	21'498	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		10'778	12'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		7'000	6'630	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		523'000	3'126	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		2'481'000	1'429'627	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		455'000	240'859	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		1'191'000	267'927	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		2'602'000	335'320	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		2'386'000	194'316	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		32'936'000	31'681'138	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.11.2023		17'789'000	896'742	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'276'000	4'722'243	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		54'430'000	6'746'054	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		2'203'359'000	13'240'866	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		2'120'000	172'674	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.11.2023		2'284'000	493'287	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.11.2023		663'000	440'371	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		51'990'000	47'316'099	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		2'932'000	1'921'926	CAD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		924'450	17'712'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		3'839	77'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		1'402'695	2'440'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		239'011	453'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		259'421	1'156'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		336'507	2'616'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		196'499	2'418'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		31'781'229	33'110'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		889'542	17'798'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		4'681'766	4'253'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		7'098'454	57'339'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		12'993'848	2'158'780'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		174'038	2'142'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		494'621	2'299'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		440'810	665'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		46'893'583	51'701'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		1'934'526	2'960'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		10'000	6'539	CAD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		80'317	73'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.12.2023		7'000	1'499	PLN/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		113'429	125'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		8'000	4'624	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		11'730'000	70'837	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		63'000	3'171	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		167'000	159'891	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		201'000	25'789	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.12.2023		27'000	3'346	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		18'000	17'291	EUR/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		1'508	7'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		9'000	5'227	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		7'729'000	46'618	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		123'000	111'149	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		4'000	2'622	CAD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		24'201	22'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		5'558	45'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		28'629	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		9'316	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		2'065	16'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		1'605	3'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		3'237	15'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		1'610	7'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		2'655	4'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		305'000	15'493		MXN/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		20'757	3'460'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		1'316	16'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		18'000	17'322		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		31'000	34'376		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		47'676	387'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		29'000	18'979		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		19'835	161'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		35'677	5'983'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		174'812	182'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		1'295	6'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		2'451	48'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		3'452	6'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		279'642	312'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'198	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		60'585	55'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		316'636	485'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		21'580	167'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		726'351	658'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		34'794	160'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		155'188	270'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		4'704'588	4'882'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'078'887	8'729'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		16'430	31'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		11'925	147'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		13'870	167'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		6'796'743	7'546'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		100'441	1'970'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		1'916'869	321'860'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		18'643	80'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		30'487	46'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		7'000	6'761		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		389'000	2'303		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		30'000	26'713		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.12.2023		31'000	3'805		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		1'641'000	9'646		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		24'000	23'086		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		4'000	4'404		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		54'843	62'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		48'092	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		69'000	61'056		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		2'468'594'000	14'519'282		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		59'556'000	51'784'538		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.12.2023		66'603'000	8'109'581		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		2'601'000	215'805		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		3'410'000	2'186'833		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.12.2023		487'000	261'543		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.12.2023		2'480'000	540'412		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		37'990'000	36'041'113		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		5'026'000	5'532'319		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		2'598'000	330'570		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		2'715'000	1'565'279		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.12.2023		2'289'000	184'631		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		715'000	465'830		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		19'448'000	973'442		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		1'243'000	290'216		ILS/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		15'116'064	2'566'168'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		53'938'406	62'257'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		8'863'691	72'885'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		223'181	2'695'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		2'280'519	3'567'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.01.2024		272'963	510'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		544'349	2'510'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		37'547'738	39'662'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		5'876'266	5'356'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		345'327	2'719'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		1'640'085	2'852'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		191'144	2'376'000		CHF/NOK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		481'746	741'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2024		1'023'735	20'630'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		305'266	1'311'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		162'503	171'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		9'000	5'186	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		12'000	7'701	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2024		216'000	26'393	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		9'103'000	53'823	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		17'000	18'698	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		707'895	813'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2024		73'000	3'640	MXN/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		29'194	134'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		132'073	140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		9'000	5'198	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		277'509	46'901'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		12'000	1'519	DKK/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		45'649	195'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2024		127'000	6'359	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		79'861	655'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		6'000	3'861	CAD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		74'709	68'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		541'000	470'374	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		3'000	1'954	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		18'000	1'501	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		139'000	121'087	USD/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		2'822	13'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		87'727	93'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		76'261	12'817'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2024		4'930	99'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		355'000	44'934	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		50'000	28'845	AUD/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		1'873	8'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		1'955	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		61'000	39'272	CAD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		29'664	27'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		44'050	361'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		25'000	16'184	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		24'000	26'379	GBP/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		2'393	391'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		38'070	44'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		4'000	3'789	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		7'747	12'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		5'825	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		161'000	152'026	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		32'290	268'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		20'698	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		14'191'000	85'130	JPY/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		1'953	9'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2024		3'721	74'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		148'755	173'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		1'721	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		7'475	7'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		2'537	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		12'342	105'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		202'476	218'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		119'579	143'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		2'352'000	293'318	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		2'602'983'000	15'538'637	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		2'797'000	1'606'233	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.01.2024		2'666'000	570'596	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2024		2'376'000	196'875	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		5'436'000	5'832'284	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		40'119'000	37'296'628	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2024		1'514'000	353'852	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2024		20'603'000	1'023'924	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.01.2024		510'000	271'759	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		2'677'000	223'530	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2024		74'058'000	8'752'915	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		62'750'000	52'811'028	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		3'479'000	2'220'507	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		741'000	472'773	SGD/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		313'369	2'517'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		15'904'616	2'660'351'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		1'680'650	2'933'000	CHF/AUD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	PLN/CHF Verfall 02.02.2024		585'246	2'744'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		202'930	2'455'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		6'290'295	5'880'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		39'249'662	42'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2024		1'053'075	21'355'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2024		286'878	540'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		236'335	2'836'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		9'349'981	79'219'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		55'806'617	66'515'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		2'375'605	3'732'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		489'749	769'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.02.2024		162'000	19'243	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		16'975'000	100'930	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		36'000	38'656	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		26'000	3'237	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		390'000	361'964	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		251'000	213'376	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		15'000	8'569	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		5'000	3'185	CAD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		119'651	20'339'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		65'666	61'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		160'000	148'706	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		19'682	31'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		26'000	22'037	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		7'606	7'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		11'907	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		162'000	151'386	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		720'000	618'249	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		1'700	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.02.2024		1'498'000	74'726	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		15'826'000	92'698	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		2'548	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		1'457'096	1'542'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		44'657	69'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		81'188	142'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		2'478'237	2'855'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		588'763	100'310'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		3'716	45'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		5'702	45'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		4'306	52'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.02.2024		79'510	367'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		184'902	168'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2024		65'728	1'299'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		287'132	2'383'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		99'933	155'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2024		4'765	9'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		1'244	15'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		2'597	4'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2024		5'660	113'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		1'645	13'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		12'918	20'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.02.2024		3'438	16'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		20'032	165'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		86'000	74'879	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		35'292	32'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		9'147	16'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		63'000	59'439	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		25'791	4'393'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		961'000	5'603	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		2'000	2'196	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		15'000	14'063	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		19'000	16'396	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		842'000	540'539	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		2'500'000	205'125	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.02.2024		21'269'000	1'062'357	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		3'079'000	1'746'132	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		1'593'000	375'617	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		2'751'631'000	16'149'047	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		3'937'000	2'527'987	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		2'549'000	318'701	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		43'052'000	40'118'006	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		68'268'000	58'566'435	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.02.2024		81'705'000	9'769'467	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		2'903'000	241'065	SEK/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/PLN Verfall 02.02.2024		3'127'000	673'487	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2024		549'000	289'916	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		6'110'000	6'674'870	GBP/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		362'769	1'557'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		6'492	28'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		1'855	8'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		531'134	829'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		201'892	2'467'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		1'037'300	20'946'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		1'689'871	2'987'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		2'461'013	3'844'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		15'511'077	2'639'002'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		310'777	2'490'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		38'957'382	41'892'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		57'342'519	67'069'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		9'785'085	81'959'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		235'502	2'842'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.03.2024		665'636	3'102'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		284'746	541'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		6'379'643	5'858'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		2'389	29'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		500'296	4'180'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		626'691	673'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		18'577	29'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		772'192	899'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'927	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		1'725	21'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		19'697	35'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.03.2024		4'960	23'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		91'532	84'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		99'873	16'931'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		10'840	217'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		4'499	36'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		2'103	4'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		14'505	121'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'287	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		12'000	13'115	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		3'851	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		21'926	3'751'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		1'504	30'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		27'619	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		2'253	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		65'000	60'672	EUR/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'947	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		605'949	694'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.03.2024		3'047	14'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		49'665	410'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		1'517	12'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		493'961	524'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		91'576	83'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		7'975	14'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		11'678	18'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		218'694	37'285'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		5'094	100'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		4'570	7'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		2'166	42'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		31'884	5'414'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		137'627	145'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		68'851	62'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		338'853	383'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		132'387	1'080'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		3'445	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		13'000	12'307	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		1'000	1'107	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.03.2024		39'000	4'753	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		25'494	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		848'000	4'979	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		18'000	17'134	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.03.2024		38'000	4'642	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		1'183'000	6'955	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		2'000	2'226	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		30'765	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		6'600	54'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		24'777	26'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		65'000	57'235		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		3'349	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		9'864	1'685'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		160'176	27'397'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		410'070	430'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		310'225	353'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		21'179	19'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		5'178	9'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		34'260	281'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		63'063	97'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.03.2024		4'001'000	2'597'609		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		69'429'000	61'138'483		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		2'729'434'000	16'058'898		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.03.2024		545'000	292'393		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		6'094'000	6'788'168		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.03.2024		2'488'000	206'728		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		2'538'000	324'458		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.03.2024		837'000	548'160		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.03.2024		88'008'000	10'754'578		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		43'594'000	41'542'902		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		1'588'000	391'519		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		2'871'000	244'351		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.03.2024		3'055'000	1'751'737		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.03.2024		21'335'000	1'100'839		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.03.2024		3'139'000	693'141		PLN/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		367'901	1'564'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		3'992	17'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		1'666	7'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		2'530'753	3'909'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		57'848'222	65'907'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		15'893'915	2'697'482'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.04.2024		288'775	540'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		6'409'737	5'772'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		532'706	815'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		10'992'926	90'103'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		39'885'569	41'940'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		387'387	1'575'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		238'336	2'806'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		1'710'474	2'990'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		1'081'143	21'124'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		683'147	3'105'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		46'202	377'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		14'978	23'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		69'224	62'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		1'733	7'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		16'648	2'820'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		1'127'585	1'278'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		2'213	10'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		7'022	136'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		1'456	17'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		441'212	461'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		9'272	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		3'285	5'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		7'851	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		91'719	15'439'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		68'044	558'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		104'559	109'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		44'615	862'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		2'603	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		67'515	77'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		1'742	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		14'896	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		2'244	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		5'854	978'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		3'911	32'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		42'996	178'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		14'375	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.04.2024		27'024	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		1'182'000	7'009		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		29'994	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		39'000	4'781		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		18'000	17'302		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		2'000	2'248		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		20'000	17'701		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		69'398	72'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.04.2024		36'000	1'894	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		3'287'000	19'549	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		7'000	7'889	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		110'000	13'526	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		6'000	3'922	CAD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		6'394	11'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		133'000	87'294	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		51'622	58'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		1'987	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		133'000	128'558	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		62'763	10'675'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		4'553	86'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		44'066	357'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		1'461	6'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		24'889	22'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		2'684	12'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		114'860	174'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		19'226	17'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		2'025	9'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		440'656	491'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		437'887	451'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		146'464	24'672'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		32'719	265'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		4'682	8'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		3'429	64'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		46'000	5'699	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		37'694	42'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		2'000	2'270	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		22'000	21'407	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		1'420'000	8'427	JPY/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		3'084	57'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		1'341	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		123'523	992'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		338'137	346'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		1'813	8'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		50'906	8'545'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		359'064	398'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		4'129	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		100'271	88'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		6'648	10'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		2'754'722'000	16'395'003	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.04.2024		1'766'000	434'189	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		5'959'000	6'780'508	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		92'489'000	11'473'260	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		3'981'000	2'649'833	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		43'221'000	42'045'389	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.04.2024		3'144'000	710'160	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		68'282'000	61'505'012	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.04.2024		825'000	550'564	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.04.2024		22'293'000	1'208'073	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.04.2024		590'000	317'851	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.04.2024		3'035'000	1'783'336	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.04.2024		2'823'000	237'781	SEK/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		202'629	2'445'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		316'483	2'480'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		2'825	22'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2024		2'502'000	326'243	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.04.2024		2'445'000	202'992	NOK/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		6'587'701	5'808'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		2'597'655	3'914'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		40'948'979	42'184'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		60'113'328	66'962'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		331'637	2'548'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		552'788	830'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2024		1'130'118	21'024'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.05.2024		323'237	602'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		1'794'107	3'061'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2024		166'951	2'016'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		239'870	2'854'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2024		47'022	874'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		4'688	8'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		1'332	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		15'878	14'000	CHF/GBP		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF		5'972	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF		1'016'622	1'132'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF		176'697	182'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF		30'654	27'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF		1'828	14'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	MXN/CHF		4'064	75'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF		5'324	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF		1'603	19'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF		9'423	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF		80'807	83'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD		335'000	302'638		USD/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF		2'008	3'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF		2'154	4'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF		7'351	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF		3'415	63'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF		129'935	114'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF		375'641	416'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF		5'324	9'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF		258'295	264'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF		1'340	2'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF		1'347	16'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF		48'716	54'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR		15'000	14'723		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD		19'000	12'681		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD		72'000	42'595		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD		14'000	7'567		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP		11'000	12'484		GBP/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF		39'387	470'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/MXN		519'000	28'213		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK		67'000	5'663		SEK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF		116'946	130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF		19'183	29'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/DKK		60'000	7'838		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR		52'000	50'656		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD		118'000	107'539		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF		111'479	115'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF		2'685	4'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF		15'364	23'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF		10'143	17'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF		1'833	14'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF		1'629	3'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF		6'700	126'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF		39'870	35'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF		1'336	16'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF		246'063	252'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF		882'221	965'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD		3'994'000	2'666'434		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK		2'502'000	207'241		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD		822'000	552'836		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN		21'643'000	1'165'060		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD		3'039'000	1'809'968		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK		2'516'000	330'829		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY		100'334'000	12'688'238		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK		2'822'000	235'806		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY		2'744'682'000	15'997'379		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD		69'206'000	63'475'743		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP		5'987'000	6'875'830		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR		43'013'000	42'185'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD		595'000	322'936		NZD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF		15'930'388	2'673'005'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF		430'359	1'755'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CNY/CHF		11'695'725	94'543'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF		704'768	3'133'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	PLN/CHF		1'575	7'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF		39'439	6'614'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF		30'812	249'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF		42'987	345'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF		3'395	15'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF		2'433	10'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF		94'875	15'848'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	PLN/CHF		2'046	9'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF		1'461	6'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF		46'016	7'702'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF		116'649	936'000		CHF/CNY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024		1'006'000	6'008		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.05.2024		36'000	4'488		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 07.05.2024		74'000	16'809		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.05.2024		41'000	9'809		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.05.2024		75'000	9'310		CNY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		50'188	8'423'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.05.2024		26'000	3'260		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024		737'000	4'356		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		202'567	34'833'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.05.2024		2'388	10'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024		553'532	4'398'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 07.05.2024		4'064	18'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.05.2024		1'740'000	427'548		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 07.05.2024		3'108'000	704'422		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		2'610'209	3'922'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		205'091	2'483'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		537'559	801'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		1'078'381	20'210'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		1'714'293	2'886'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		324'252	2'471'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		12'638'339	100'135'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		234'870	2'817'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		15'521'382	2'660'217'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		61'492'378	67'287'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		6'637'071	5'799'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		41'379'925	42'291'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.06.2024		695'862	3'081'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		247'000	225'750		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		8'000	9'153		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		4'011'000	23'391		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		4'000	2'375		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		25'000	1'332		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		5'000	3'325		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.06.2024		151'000	19'052		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		201'000	196'526		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		14'000	8'340		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		31'272	248'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		198'000	192'924		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		14'000	1'830		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		250'000	227'648		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		44'236	7'453'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		5'980	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		57'000	7'432		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.06.2024		58'000	4'823		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.06.2024		72'000	16'144		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		68'598	104'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		56'830	1'076'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		66'000	5'513		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		203'183	1'617'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		747'671	769'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		264'080	44'576'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		1'034'540	1'147'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.06.2024		18'000	12'046		SGD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		106'407	94'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		67'000	39'979		AUD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		21'626	403'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		8'800	9'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.06.2024		39'000	26'095		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		3'970	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		6'817	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		39'535	66'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.06.2024		122'000	10'215		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		139'000	11'625		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		3'628	29'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		121'000	15'862		DKK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		53'351	59'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.06.2024		152'000	34'656		PLN/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		54'512	9'372'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		6'000	3'976		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		9'000	10'281		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.06.2024		170'000	21'286		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		4'546'000	26'503		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		27'468	28'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		4'000	2'409		AUD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		36'000	1'940		MXN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		38'827	43'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		1'126'440	20'616'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		15'937'773	2'732'744'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.06.2024		800'173	3'451'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		557'274	826'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		6'916'212	5'987'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		2'695'812	4'049'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		1'745'520	2'881'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		12'788'521	101'968'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		62'014'781	68'301'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		227'111	2'666'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		411'626	3'113'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		42'666'912	43'249'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		266'050	3'131'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.06.2024		60'000	7'562		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		32'000	31'681		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		42'010	46'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		2'000	2'325		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		349'000	318'907		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		169'000	167'548		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		5'000	3'343		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		7'000	8'150		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		3'611'000	21'045		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.06.2024		135'000	17'001		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		28'000	1'529		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		3'000	1'818		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		14'564	116'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		372'406	408'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		6'962	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		48'369	49'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		18'044	3'112'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		1'291	24'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		2'663	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		1'813	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		189'000	185'168		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		15'204	23'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		2'364	18'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		1'621	19'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		3'348	5'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		1'460	17'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.06.2024		1'160'219	9'312'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		6'387	120'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		9'604	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		89'655	15'535'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		39'138	34'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		178'000	160'859		USD/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.06.2024		4'805	21'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.06.2024		1'144'000	634'131		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		5'460'841'000	31'351'780		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.06.2024		212'909'000	26'426'265		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.06.2024		4'986'000	428'397		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		11'900'000	13'667'626		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		42'360'000	2'240'780		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		5'762'000	494'322		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		136'267'000	122'926'461		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.06.2024		1'575'000	1'051'234		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.06.2024		6'329'000	1'450'341		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		5'760'000	3'456'000		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		5'410'000	710'387		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		8'101'000	5'361'080		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		85'606'000	83'833'956		EUR/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2024		420'393	1'715'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		316'329	585'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		40'000	9'721		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2024		12'000	6'509		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		84'000	20'431		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2024		28'000	15'252		NZD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2024		505'578	2'041'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		330'142	596'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2024		2'926	12'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		1'660	3'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		3'644'000	883'706		ILS/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		424'820	4'957'000		CHF/NOK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		13'925'855	12'162'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		30'802'355	5'359'448'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		489'895	5'721'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.07.2024		2'247'844	42'823'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		125'147'263	139'177'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		1'047'898	1'573'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.07.2024		1'436'043	6'289'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		3'429'755	5'730'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		700'414	5'343'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		83'818'222	85'760'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		2'218	17'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.07.2024		5'444	24'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		834'041	933'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		369'676	380'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		10'156	17'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		101'640	89'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		84'550	14'711'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		121'551	183'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		1'366	16'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.07.2024		123'417	2'433'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.07.2024		654'000	56'022		SEK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		46'970	8'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		53'000	51'436		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		20'486	18'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		4'734	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.07.2024		117'000	77'449		SGD/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.07.2024		2'029	9'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		40'138	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.07.2024		3'541	70'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		11'000	9'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.07.2024		1'075'000	6'021		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		38'000	33'927		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.07.2024		2'000	2'255		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		17'000	16'218		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		11'495	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		4'452	797'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		28'000	25'109		USD/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		3'303	5'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		284'391	296'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		11'944	20'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		14'092	2'523'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		2'448	19'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.07.2024		1'669'000	81'457		MXN/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		1'522	18'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		1'432	17'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.07.2024		4'896	22'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		452'053	504'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		49'916	44'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		8'235'000	5'407'249		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		140'582'000	126'321'362		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.07.2024		1'644'000	1'090'005		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.07.2024		43'657'000	2'145'318		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.07.2024		5'085'000	431'411		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		86'378'000	83'182'014		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.07.2024		4'990'000	421'106		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.07.2024		5'384'604'000	30'077'859		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.07.2024		12'311'000	13'983'942		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.07.2024		5'379'000	694'590		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.07.2024		5'775'000	3'465'578		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.07.2024		6'344'000	1'417'998		PLN/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		628'792	1'138'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		869'149	3'592'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		26'768'186	215'916'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		5'373'369	8'141'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		3'865	7'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		25'314	205'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		34'771	53'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		40'994	333'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		7'806	12'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		1'202	5'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		1'993'000	244'445		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		42'000	5'147		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		3'810	31'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		2'186	4'000		CHF/NZD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		2'863	12'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		18'999	29'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		90'658	738'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		215'188'000	26'483'187	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.07.2024		1'149'000	629'040	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.07.2024		3'609'000	860'819	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.08.2024		27'809'575	226'337'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		128'751'274	143'879'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.08.2024		1'100'468	1'664'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.08.2024		2'134'587	43'850'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		440'765	5'208'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		83'471'873	86'898'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.08.2024		425'117	5'054'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		30'120'425	5'386'554'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.08.2024		636'344	1'167'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		14'282'584	12'623'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.08.2024		706'087	5'480'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.08.2024		1'426'334	6'410'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		49'000	55'805	GBP/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		78'555	14'034'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		168'000	162'575	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.08.2024		124'674	1'009'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.08.2024		698'000	628'576	USD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.08.2024		4'961	102'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.08.2024		15'000	1'947	DKK/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.08.2024		5'314	8'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		15'000	14'552	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		2'000	2'295	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		33'981	38'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.08.2024		962'000	5'377	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.08.2024		40'000	4'918	CNY/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.08.2024		70'183	309'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		26'348	23'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		57'815	10'386'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.08.2024		322'131	2'621'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.08.2024		3'773	76'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		814'478	910'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		395'390	408'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.08.2024		11'733'000	66'185	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		27'000	31'116	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		377'097	423'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.08.2024		11'000	1'432	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.08.2024		498'000	61'196	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.08.2024		95'000	4'738	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.08.2024		3'000	1'995	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.08.2024		14'000	3'191	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		188'000	182'535	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.08.2024		64'795	532'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		33'259	29'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.08.2024		458'000	406'781	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		194'408	201'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		71'011	12'522'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.08.2024		574'497	4'722'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		2'454'973	2'782'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		1'439'179	1'502'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		321'003	283'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		560'106	97'372'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.08.2024		12'602	264'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.08.2024		132'705	254'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		12'497	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		309'141	323'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.08.2024		25'491	209'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		316'157	357'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		95'777	16'712'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.08.2024		5'524'885'000	32'321'130	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		88'961'000	84'735'353	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.08.2024		44'197'000	2'088'105	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.08.2024		6'705'000	1'487'176	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.08.2024		5'454'000	696'149	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.08.2024		5'208'000	427'681	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.08.2024		1'421'000	742'899	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.08.2024		1'669'000	1'098'285	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.08.2024		234'892'000	28'605'148	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		12'891'000	14'574'436	GBP/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 05.08.2024		147'233'000	129'595'959		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.08.2024		5'054'000	406'796		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		5'467'696	8'355'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.08.2024		866'645	3'644'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		3'470'879	5'803'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		11'000	7'219		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		23'372	39'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		56'676	94'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		9'191	14'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.08.2024		7'000	1'715		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		18'000	11'794		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.08.2024		12'000	7'261		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		12'264	19'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		165'790	260'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		87'332	151'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		8'619'000	5'491'682		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.08.2024		6'075'000	3'491'728		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.08.2024		3'637'000	851'278		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		5'596'479	8'807'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		32'460'050	5'543'865'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		84'950'944	89'383'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.09.2024		2'101'850	44'863'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.09.2024		3'518'418	6'138'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.09.2024		1'512'894	6'848'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.09.2024		715'190	5'614'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.09.2024		437'424	5'338'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.09.2024		868'517	3'718'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.09.2024		764'232	1'467'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.09.2024		1'130'055	1'721'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		29'827'392	245'285'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.09.2024		14'961'347	13'277'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		133'178'862	151'849'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.09.2024		414'693	5'167'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.09.2024		110'779	101'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2024		27'606'000	161'879		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		292'159	312'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.09.2024		7'295	163'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		22'880	37'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.09.2024		7'623	35'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		873'293	1'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.09.2024		96'640	173'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		27'985	233'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		187'898	202'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		32'994	39'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		8'271	1'388'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		13'000	11'214		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		48'030	8'174'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2024		25'000	27'442		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.09.2024		474'000	57'117		CNY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.09.2024		85'101	1'899'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		47'157	75'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		66'000	62'315		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2024		11'000	6'293		AUD/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.09.2024		5'888	9'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		11'371	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		9'782	81'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		33'000	28'582		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		7'713	1'313'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		4'286'499	4'528'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.09.2024		10'984	21'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		251'706	402'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		1'690'356	289'953'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.09.2024		12'621	55'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.09.2024		30'386	694'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.09.2024		6'487	78'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		6'169'422	7'247'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.09.2024		833'408	747'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		1'527'874	12'810'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.09.2024		10'530	83'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.09.2024		187'564	328'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.09.2024		22'302	101'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.09.2024		16'252	25'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.09.2024		6'115	76'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2024		54'000	60'404		GBP/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		10'035	16'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2024		5'507'000	32'205		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		27'000	25'601		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2024		107'000	56'302		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		153'448	181'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		52'632	442'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		23'419	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		35'341	42'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		248'279	2'101'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.09.2024		6'548	52'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.09.2024		26'508	46'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.09.2024		7'449	34'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.09.2024		11'913	279'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		182'541	31'276'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.09.2024		978'790	8'184'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		33'369	53'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		81'000	76'090		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		1'592'000	1'350'670		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.09.2024		261'196	234'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.09.2024		7'810	12'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2024		5'416'000	448'635		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2024		5'842'856'000	34'046'240		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.09.2024		5'749'000	723'765		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.09.2024		5'243'000	419'875		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2024		6'674'000	3'841'501		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2024		14'280'000	15'921'129		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2024		9'390'000	5'910'507		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		94'288'000	88'539'638		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2024		1'381'000	732'969		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		158'740'000	134'660'888		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.09.2024		3'773'000	882'429		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.09.2024		7'018'000	1'541'490		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.09.2024		47'898'000	2'068'619		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.09.2024		268'662'000	32'162'200		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.09.2024		1'767'000	1'150'083		SGD/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		454'497	5'497'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		35'034'260	6'007'885'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		731'554	5'821'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		428'875	5'370'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		3'904'879	6'802'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		16'169'398	14'547'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		5'960'797	9'493'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		90'047'212	96'089'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.10.2024		810'483	1'532'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		138'505'720	163'814'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.10.2024		962'084	4'124'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.10.2024		1'548'434	7'076'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		1'164'375	1'792'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		84'177	146'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		70'857	109'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		83'142	14'346'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		290'539	309'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		21'202	19'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		70'360	558'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.10.2024		543'000	460'639		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		527'793	623'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		131'743	22'552'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		116'510	105'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		347'549	371'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		74'501	12'582'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		8'414	9'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		67'068	108'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.10.2024		6'978	32'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		6'477	10'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		197'369	235'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		7'730	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.10.2024		91'000	76'970		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		35'441	38'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		13'409	2'256'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		6'368	77'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		15'694	24'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.10.2024		19'319	88'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.10.2024		12'579	24'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		769'336	690'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		10'475	83'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		175'147	307'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		1'602'279	267'304'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		3'952'050	4'197'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		255'869	408'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		6'124'451	7'185'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		6'408	81'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.10.2024		14'652	64'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		14'655	176'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		16'845'842	19'879'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		25'675	203'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		217'605	332'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		4'277'425	720'520'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		11'026'416	11'687'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		13'953	173'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		492'577	854'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		700'876	1'123'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.10.2024		303'432	1'375'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.10.2024		25'880	49'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		1'946'078	1'733'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.10.2024		29'869	133'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		11'011	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		44'400	7'483'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		9'447	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		406'202	359'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.10.2024		5'627	25'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		1'981'677	2'102'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		150'357	1'189'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		2'959'922	3'502'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.10.2024		9'733	44'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		8'547	13'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		38'891	62'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.10.2024		189'156	354'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		26'125	45'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		666'124	113'131'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		73'066	873'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		105'553	17'948'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.10.2024		42'000	9'327	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.10.2024		44'000	5'594	DKK/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		146'782	1'819'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.10.2024		34'000	38'579	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		179'068	284'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.10.2024		12'000	7'917	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.10.2024		12'000	6'416	NZD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		345'311	407'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.10.2024		24'000	5'442	ILS/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		285'368	301'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		47'748	82'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		5'806	46'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.10.2024		10'793	49'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		8'550	13'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		30'338	52'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		13'544	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		996'701	1'184'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.10.2024		76'126'000	448'607	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.10.2024		507'000	316'517	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		655'000	616'440	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.10.2024		6'623'000	551'100	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.10.2024		196'208'000	165'503'410	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.10.2024		4'322'000	980'100	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.10.2024		2'281'000	1'500'807	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.10.2024		7'856'000	992'056	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.10.2024		8'288'000	4'849'972	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.10.2024		7'443'000	596'035	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.10.2024		7'109'881'000	41'926'968	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		114'458'000	107'750'761	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.10.2024		8'622'000	1'895'762	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.10.2024		10'971'000	6'850'073	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.10.2024		17'438'000	19'732'143	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.10.2024		1'947'000	1'044'916	NZD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024		2'179'996	50'881'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024		8'948	214'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024		28'255	654'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024		354'456	8'099'000	CHF/MXN		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024		14'378	329'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.10.2024		315'000	13'701		MXN/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024		14'884	347'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.10.2024		60'209'000	2'590'896		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		32'670'016	273'115'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		171'036	1'431'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		23'860	200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		73'929	622'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		12'949	109'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		1'429'636	11'940'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		3'989'253	33'274'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 09.10.2024		373'000	44'747		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		1'815'498	15'069'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 09.10.2024		2'067'000	249'576		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024		276'056	2'289'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 09.10.2024		335'609'000	40'447'597		CNY/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.11.2024		555'520	6'691'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.11.2024		166'117'424	197'684'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 04.11.2024		979'683	4'334'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 04.11.2024		1'515'942	2'309'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 04.11.2024		2'641'725	61'927'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 04.11.2024		1'000'323	7'938'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 04.11.2024		595'802	7'466'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 04.11.2024		40'715'107	338'185'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.11.2024		4'846'291	8'309'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		108'233'350	115'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 04.11.2024		1'904'729	8'702'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.11.2024		6'894'309	11'075'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		19'563'736	17'355'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.11.2024		1'049'610	1'963'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 05.11.2024		42'111'434	7'136'104'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	4'410'462.17	0.68
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	577'937'432.16	89.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	62'329'960.68	9.60
Sonstige Vermögenswerte	4'698'279.42	0.72
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	649'376'134.43	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-7'501.74	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	649'368'632.69	

Bewertungskategorien	Kurswert USD	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	640'267'392.84	98.60
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = USD	0.69375000
CAD	1 = USD	0.74021985
CHF	1 = USD	1.18546618
CNY	1 = USD	0.14288470
DKK	1 = USD	0.14971180
EUR	1 = USD	1.11604652
GBP	1 = USD	1.34135000
ILS	1 = USD	0.26883888
JPY	1 = USD	0.00699105
MXN	1 = USD	0.05101520
MYR	1 = USD	0.24251243
NOK	1 = USD	0.09494287
NZD	1 = USD	0.63625000
PLN	1 = USD	0.26066783
SEK	1 = USD	0.09865241
SGD	1 = USD	0.78003120

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	472'674'983.83	72.790
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	276'276'203.68	42.545

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DA USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.007
FA USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.007
GT USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.007
NT USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.007
NTH1 CHF	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.007

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 18 Ziff. 3 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DA USD	0.180	0.400	0.130	0.050	4.000
FA USD	0.180	0.500	0.130	0.050	4.000
GT USD	0.140	0.350	0.090	0.050	4.000
NT USD	-	-	-	-	4.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	4.000

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

8 Benchmark

FTSE non-CHF World Government Bond Index

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 15.01.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.01.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DA USD	Ja	USD	1.60000	0.56000	1.04000
FA USD	Ja	USD	1.60000	0.56000	1.04000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 15.01.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.01.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT USD	Ja	USD	2.004	0.701	1.303
NT USD	Ja	USD	2.066	0.723	1.343
NTH1 CHF	Ja	USD	2.279	0.797	1.482

12 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 14) Klassenbezeichnung per 14.09.2022: von NTH CHF Klasse in NTH1 CHF Klasse.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert des Anlagefonds und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit der Währung des Anlagefonds, oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes

unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen, getätigt wurden.