

Jahresbericht 2023/2024

Geprüfter Jahresbericht
per 31. März 2024



Anlagefonds schweizerischen Rechts mit mehreren Teilvermögen (Umbrella-Fonds) für qualifizierte Anleger der Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

- UBS (CH) Institutional Fund 3
- Swiss Real Estate Securities Selection Passive II
- CHF Exposure
- Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II
- Bonds CHF Inland Government Passive II
- Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II
- Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II
- Equities Switzerland II
- Bonds CHF Short Term II
- Bonds CHF Inland Medium Term Passive II
- Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II
- Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II

Inhaltsverzeichnis

| | |
|---|-----|
| Anlagekategorie und ISIN | 2 |
| Organisation | 3 |
| Mitteilungen an die Anleger | 4 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II | 8 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – CHF Exposure | 17 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II | 22 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Government Passive II | 32 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II | 38 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II | 72 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II | 91 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Short Term II | 98 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II | 109 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II | 118 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II | 128 |
| Anhang zu Ergänzende Angaben | 182 |
| Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft | 188 |
| Fakten und Konditionen (ungeprüft) | 191 |

Verkaufsrestriktionen

Anteile der Teilvermögen des Umbrella-Fonds dürfen innerhalb der USA weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden.

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

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

Anlagekategorie und ISIN

UBS (CH) Institutional Fund 3 –

Swiss Real Estate Securities Selection Passive II

| | |
|------|--------------|
| I-A1 | CH0042114261 |
| I-A2 | CH0257359726 |
| I-A3 | CH0487119098 |
| I-B | CH0042114337 |
| I-X | CH0042114378 |

CHF Exposure

| | |
|-----|--------------|
| I-X | CH0043947545 |
|-----|--------------|

Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II

| | |
|------|--------------|
| I-A1 | CH0126480547 |
| I-B | CH0126480554 |
| I-X | CH0126480562 |

Bonds CHF Inland Government Passive II

| | |
|------|--------------|
| I-A1 | CH0048666470 |
| I-A3 | CH0048666496 |
| I-X | CH0048666462 |

Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II

| | |
|------|--------------|
| I-A1 | CH0244552409 |
| I-B | CH0244558828 |
| I-X | CH0244558836 |

Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II

| | |
|-----|--------------|
| I-X | CH0259022512 |
|-----|--------------|

Equities Switzerland II

| | |
|-----|--------------|
| I-B | CH0229995755 |
| I-X | CH0229995763 |

Bonds CHF Short Term II

| | |
|------|--------------|
| I-A1 | CH0232004066 |
| I-B | CH0232006095 |
| I-X | CH0232006111 |

Bonds CHF Inland Medium Term Passive II

| | |
|-----|--------------|
| I-X | CH0232004017 |
|-----|--------------|

Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II

| | |
|-----|--------------|
| I-X | CH0232003951 |
|-----|--------------|

Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II

| | |
|-----|--------------|
| I-X | CH1162399898 |
|-----|--------------|

Organisation

Fondsleitung

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

Verwaltungsrat

Michael Kehl

Präsident

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Dr. Daniel Brüllmann

Vizepräsident

Managing Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Francesca Gigli Prym

Mitglied

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

Dr. Michèle Sennhauser

Mitglied

Executive Director, UBS Asset Management
Switzerland AG, Zürich

Franz Gysin

Unabhängiges Mitglied

Werner Strebel

Unabhängiges Mitglied

Geschäftsleitung

Eugène Del Cioppo

CEO

Georg Pfister

Stellvertretender CEO sowie Operating Office, Finance, HR

Urs Fäs

Real Estate Fund

Christel Müller

Business Risk Management

Thomas Reisser

Compliance & Operational Risk Control

Matthias Börlin

Admin, Custody & Tax Oversight

Daniel Diaz

Delegation & Investment Risk Management

Melanie Gut

Corporate & Regulatory Governance

Patric Schläpfer

Corporate Services

Hubert Zeller

White Labelling Solutions Schweiz

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich

Prüfungsgesellschaft

Ernst & Young AG, Basel

Übertragung der Anlageentscheide

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive
(CHF hedged) II

– Bonds Emerging Markets Sovereign Passive
(CHF hedged) II

UBS Asset Management (Americas) LLC, New York und

UBS Asset Management (UK) Ltd, London

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II

– Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II
UBS Asset Management (UK) Ltd, London.

Alle restlichen Teilvermögen

UBS Asset Management Switzerland AG, Zürich

Übertragung der Administration

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

Zahlstellen

UBS Switzerland AG, Zürich

und ihre Geschäftsstellen in der Schweiz

Mitteilungen an die Anleger

Fondsvertragsänderungen

UBS (CH) Institutional Fund 3

- Swiss Real Estate Securities Selection Passive II
- CHF Exposure
- Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II
- Bonds CHF Inland Government Passive II
- Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II
- Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II
- Equities Switzerland II
- Bonds CHF Short Term II
- Bonds CHF Inland Medium Term Passive II
- Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II
- Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II

Mitteilung vom 21. März 2023

1. Allgemeine Änderungen

Der Fondsvertrag mit Anhang wird dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG), dem revidierten Kollektivanlagengesetz (KAG), den dazugehörigen Verordnungen und den darauf basierenden neuen Musterdokumenten angepasst.

2. Die Anleger (§ 5)

Unter §5 Ziff. 1 soll der Kreis der Anleger neu präzisiert werden, um sich auf qualifizierte Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3 und 3ter KAG zu beschränken.

Der restliche Fondsvertrag soll in der Folge ebenfalls angepasst werden, wie nachstehend dargestellt.

3. Anteile und Anteilsklassen (§ 6)

Die Anteilsklasse Q soll für alle Teilvermögen in den Fondsvertrag und Anhang integriert werden. Ziff. 4 soll in der Folge neu wie folgt lauten:

«Zur Zeit bestehen für alle Teilvermögen folgende Anteilsklassen mit den Bezeichnungen «I-A1», «I-A2», «I-A3», «I-B», «I-X», «U-X» und «Q».

Die Anteilsklassenbeschreibung der neuen Klasse «Q» soll in Ziff. 4, Bst. g) wie folgt lauten:

«Anteile der Anteilsklasse «Q» werden ausschliesslich Finanzintermediären angeboten, die Investitionen auf eigene Rechnung tätigen, und/oder Kunden von solchen Finanzintermediären angeboten, welche gemäss regulatorischen Anforderungen keine Vertriebskommission erhalten dürfen und/oder die laut schriftlichen Verträgen mit ihren Kunden diesen, sofern im entsprechenden Anlagefonds verfügbar, nur Klassen ohne Retrozession anbieten können. Nur als Inhaberanteile emittiert. Die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen durch Sacheinlagen und Sachauslagen ist ausgeschlossen.

Es besteht keine erforderliche Mindestinvestition. Die Anteilsklasse unterscheidet sich ausserdem von allen anderen Anteilsklassen durch den höheren Erstausgabepreis und steht ausschliesslich anderen kollektiven Kapitalanlageformen (ungeachtet ihrer Rechtsform) zwecks administrativer Vereinfachung zu Verfügung.»

Die Anteilsklassenbeschreibung der bestehenden Klassen soll in Ziff. 4, Bst. a) – f) ebenfalls angepasst werden und jeweils neu wie folgt lauten:

«a) «I-A1»: Anteile der Anteilsklasse «I-A1» werden ausschliesslich qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3-3ter KAG angeboten. Nicht für diese Anteilsklasse qualifizieren Privatkundinnen und –kunden gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die von einem Finanzintermediär Anlageberatung im Rahmen eines auf Dauer angelegten Anlageberatungsverhältnisses erhalten. Die Kosten für Vermögensverwaltung, Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) werden mittels Verwaltungskommission direkt dem Vermögen des Teilvermögens belastet. Es besteht keine erforderliche Mindestinvestition.

b) «I-A2»: Anteile der Anteilsklasse «I-A2» werden ausschliesslich qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3-3ter KAG angeboten, die mit UBS Asset Management Switzerland AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner eine schriftliche Vereinbarung zwecks Investition in ein oder mehrere Teilvermögen dieses Anlagefonds unterzeichnet haben. Nicht für diese Anteilsklasse qualifizieren Privatkundinnen und –kunden gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die von einem Finanzintermediär Anlageberatung im Rahmen eines auf Dauer angelegten Anlageberatungsverhältnisses erhalten. Die Kosten für Vermögensverwaltung, Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) werden mittels Verwaltungskommission direkt dem Vermögen des Teilvermögens belastet. Es besteht eine erforderliche Mindestinvestition, welche im Anhang erwähnt wird.

c) «I-A3»: Die Anteilsklasse wird ausschliesslich qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3 – 3ter KAG angeboten, die mit UBS Asset Management Switzerland AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner eine schriftliche Vereinbarung zwecks Investition in ein oder mehrere Teilvermögen dieses Anlagefonds unterzeichnet haben. Nicht für diese Anteilsklasse qualifizieren Privatkundinnen und –kunden gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die von einem Finanzintermediär Anlageberatung im Rahmen eines auf Dauer angelegten Anlageberatungsverhältnisses erhalten. Die Kosten für Vermögensverwaltung, Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) werden mittels Verwaltungskommission direkt dem Vermögen des Teilvermögens belastet. Es besteht eine erforderliche Mindestinvestition, welche im Anhang erwähnt wird.

d) «I-B»: Anteile der Anteilsklasse «I-B» werden ausschliesslich qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3-3ter KAG angeboten, die mit UBS Asset Management Switzerland AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner eine schriftliche Vereinbarung zwecks Investition in ein oder mehrere Teilvermögen dieses Anlagefonds unterzeichnet haben. Nicht für diese Anteilsklasse qualifizieren Privatkundinnen und –kunden gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die von einem Finanzintermediär Anlageberatung im Rahmen eines auf Dauer angelegten Anlageberatungsverhältnisses erhalten. Die Kosten für Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) werden mittels Verwaltungskommission direkt dem Vermögen des Teilvermögens belastet. Die Kosten für die Vermögensverwaltung sowie die Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen werden dem Anleger im Rahmen

der oben genannten schriftlichen Vereinbarung in Rechnung gestellt. Diese mit dem Anleger abgeschlossene schriftliche Vereinbarung deckt die vom Anleger zu tragenden Kosten der Dienstleistungsbestandteile der Vermögensverwaltung und der Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen, nicht aber diejenigen der Fondsadministration. Die in dieser Vereinbarung getroffene Gebührenregelung kann je nach Anleger unterschiedlich sein (vgl. Abschnitt 1 im Anhang). Es besteht keine erforderliche Mindestinvestition.

e) «I-X»: Anteile der Anteilsklasse «I-X» werden ausschliesslich qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3-3ter KAG angeboten, die mit UBS Asset Management Switzerland AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner eine schriftliche Vereinbarung zwecks Investition in ein oder mehrere Teilvermögen dieses Anlagefonds unterzeichnet haben. Nicht für diese Anteilsklasse qualifizieren Privatkundinnen und -kunden gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die von einem Finanzintermediär Anlageberatung im Rahmen eines auf Dauer angelegten Anlageverhältnisses erhalten. Die Kosten für Vermögensverwaltung, Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) werden dem Anleger im Rahmen der oben genannten schriftlichen Vereinbarung in Rechnung gestellt. Die Entschädigung deckt die vom Anleger zu tragenden Kosten der Dienstleistungsbestandteile der Vermögensverwaltung, der Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und der Fondsadministration. Die in dieser Vereinbarung getroffene Gebührenregelung kann je nach Anleger unterschiedlich sein (vgl. Abschnitt 1 im Anhang). Es besteht keine erforderliche Mindestinvestition.

f) «U-X»: Die Anteilsklasse wird ausschliesslich qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3 – 3ter KAG angeboten, die mit UBS Asset Management Switzerland AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner eine schriftliche Vereinbarung zwecks Investition in ein oder mehrere Teilvermögen dieses Anlagefonds unterzeichnet haben. Die Kosten für Vermögensverwaltung, Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) werden dem Anleger im Rahmen der oben genannten schriftlichen Vereinbarung in Rechnung gestellt. Diese Entschädigung deckt die vom Anleger zu tragenden Kosten der Dienstleistungsbestandteile der Vermögensverwaltung, der Vertriebstätigkeit in Bezug auf die Teilvermögen und der Fondsadministration. Die in dieser Vereinbarung getroffene Gebührenregelung kann je nach Anleger unterschiedlich sein (vgl. Abschnitt 1 im Anhang).»

4. Anlagepolitik (§ 8)

Ziff. 1 Bst a) der allgemeinen Anlagepolitik soll angepasst werden und eingangs neu wie folgt lauten:

«Effekten, das heisst massenweise ausgegebene Wertpapiere und nicht verkündete Rechte mit gleicher Funktion (Wertrechte), die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, und die ein Beteiligungs- oder Forderungsrecht (einschliesslich börsennotierte SPACs) oder das Recht verkörpern, solche Wertpapiere und Wertrechte durch Zeichnung oder Austausch zu erwerben, wie namentlich Warrants; [...]»

Die spezielle Anlagepolitik des Teilvermögens «– Equities Switzerland II» soll im besonderen Teil des Fondsvertrags, Teil II, in Bst. I, c) um eine entsprechende Anlagebeschränkung von

10% in Bezug auf Anlagen in SPACs ergänzt werden. Weitere Erläuterungen wurden in den Anhang aufgenommen.

Die spezielle Anlagepolitik diverser Teilvermögen soll im besonderen Teil des Fondsvertrags, Teil II, angepasst werden.

Die neue Ziff. 2 des Teilvermögens «– Swiss Real Estate Securities Selection Passive II» in Bst. A soll wie folgt lauten:

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich darin, langfristig eine Performance zu erzielen, welche die Entwicklung der gängigen Marktindices für schweizerische Immobilienanlagefonds und Anlagen in schweizerischen Wertpapieren von Gesellschaften, deren Hauptaktivität im Besitz, Kauf und Verkauf und der Entwicklung von Immobilien besteht. Die Fondsleitung orientiert sich bei der Verwaltung des Vermögens des Teilvermögens an einem repräsentativen Referenzindex (Benchmark) für schweizerische Immobilienanlagefonds und Anlagen in schweizerischen Wertpapieren von Gesellschaften, deren Hauptaktivität im Besitz, Kauf und Verkauf und der Entwicklung von Immobilien steht, und welcher in Ziff. 6 dieses Anhangs aufgeführt ist.»

Bst c) der Ziff. 3 soll wie folgt ergänzt werden:

«Die Fondsleitung kann gemäss vorstehenden Bestimmungen einen wesentlichen Teil des Vermögens des Teilvermögens in Immobilienfonds investieren. Diese Immobilienfonds sind typischerweise an der Börse gelistet und deren Anteile werden täglich zu Marktpreisen gehandelt. Marktbedingungen können dazu führen, dass die Anteile der Immobilienfonds mit hohem Disagio gehandelt werden. Unter solchen Umständen kann es vorkommen, dass es nicht im Interesse der Anleger liegt, dass die Anteile der Immobilienfonds an der Börse verkauft werden, sondern die Rücknahme der Anteile über den Primärmarkt erfolgt, wobei Kündigungsfristen von bis zu einem Jahr eingehalten werden müssten. Solche Marktbedingungen können beim Teilvermögen zu Liquiditätsengpässen führen. Als Folge davon ist es möglich, dass die Fondsleitung Rücknahmen nicht bedienen kann.»

Die neuen Ziff. 2 und Ziff. 3 der aktiv verwalteten ESG integrierten Teilvermögen sollen wie folgt lauten:

«2. Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich darin, unter Berücksichtigung der Risiken von Anlagen in auf Schweizer Franken (CHF) lautende Obligationen / in Schweizerische Aktien, über einen vollen Marktzyklus eine bessere risiko-adjustierte Rendite als der repräsentative Referenzindex (Benchmark) für auf Schweizer Franken (CHF) lautende Obligationen / für schweizerische Aktienanlagen zu erzielen. Der Referenzindex ist in Ziff. 6.1 dieses Anhangs aufgeführt.

3. UBS Asset Management kategorisiert dieses Teilvermögen als ESG Integration Fonds. Es wird der ESG Integrationsansatz angewendet, jedoch kein spezifisches Nachhaltigkeits- oder Wirkungsziel verfolgt. Der Vermögensverwalter kann unter Beachtung aller Risikoaspekte und Chancen mit entsprechender Begründung und Dokumentation in Titel investierten, die ein erhöhtes ESG Risiko aufweisen.»

Davon betroffen sind die Teilvermögen «– CHF Exposure» (Bst. B.), «– Bonds CHF Ausland II» (Bst. E), «– Bonds CHF Inland II» (Bst. F), «– Equities Switzerland II» (Bst. I) und «– Bonds CHF Short Term II» (Bst. J).

Die neue Ziff. 2 des Teilvermögens «– Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II» in Bst. C soll wie folgt lauten:

«Das Anlageziel des Teilvermögens besteht hauptsächlich darin, ein breit diversifiziertes Exposure zu den Rohstoffmärkten zu bieten und eine langfristige Performance zu erzielen, die sich aus der Wertentwicklung des im Anhang genannten Index ableitet. Es kann keine Gewähr gegeben werden, dass das Anlageziel erreicht wird.»

Für die Teilvermögen «– Bonds CHF Inland Government Passive II» (Bst. D), «– Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II» (Bst. H), «– Bonds CHF Inland Medium Term Passive II» (Bst. K) und «– Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II» (Bst. L) soll Ziff. 2 ebenfalls neu ergänzt werden und das Anlageziel beschreiben. Die vorgenannten Teilvermögen beabsichtigen, einen repräsentativen Referenzindex passiv nachzubilden und eine Performance zu erzielen, welche dessen Entwicklung entspricht. Weitere Hinweise sind dem Fondsvertrag und Ziff. 6 des Anhangs zu entnehmen.

In den Bestimmungen für das Teilvermögen «– Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II», Bst. M, Ziff. 3, d), soll dieser Hinweis ergänzt werden:

«Dieses Teilvermögen dient als Zielfonds für die Teilvermögen «PF Pension – ESG 25 Fund» sowie «PF Pension – ESG 50 Fund» (Dachfonds). Der Dachfonds «PF Pension – ESG 25 Fund» darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften bis zu 45% der Anteile dieses Zielfonds erwerben. Der Dachfonds «PF Pension – ESG 50 Fund» darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften bis zu 49% der Anteile dieses Zielfonds erwerben.»

Für die Teilvermögen «– Bonds CHF Ausland II», Bst. E und «– Bonds CHF Inland II», Bst. F, soll folgender Satz unter Ziff. 4 b) entfernt werden; und für die Teilvermögen «– Bonds CHF Inland Medium Term Passive II», Bst. K und «– Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II», Bst. L soll folgender Satz in Ziff. 3 b) entfernt werden:

«[...]auf frei konvertierbare Währungen lautende Obligationen, Notes sowie andere fest- oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte von in- und ausländischen Emittenten, die ein Mindest-Rating von BBB- von S&P oder Fitch oder Baa3 von Moody's oder ein gleichwertiges Rating (Investment Grade) aufweisen[...].»

5. Ausgabe und Rücknahme von Anteilen (§ 17)

Folgende Bestimmung soll unter einer neuen Ziff. 8 ergänzt werden:

«Die Fondsleitung behält sich für das Teilvermögen - Swiss Real Estate Securities Selection Passive II vor unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw ungenügender Liquidität des dem Referenzindex zugrunde liegenden Marktes, im Interesse der im Anlagefonds verbleibenden Anleger, alle Rücknahmeanträge an Tagen herabzusetzen (Gating), an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto (ohne Berücksichtigung von Sachein- bzw. -auslieferungen) 15 Mio Schweizer Franken übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahmeanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.»

6. Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Vermögens der Teilvermögen (§ 19)

Folgende Kommissionen sollen für die in §19 Ziff. 1 erwähnten Anteilklassen neu ergänzt werden:

«b) Anteilsklasse «I-B»

Für die Anteilsklassen gilt eine Kommission für Fondsadministration von maximal 0.200% p.a. Zusätzlich werden die durch den Anleger zu tragenden Kosten (maximal 1.3% des Nettoinventarwertes) für die Vermögensverwaltung und den Vertriebstätigkeit über eine von UBS mit dem Anleger individuell ausgehandelte schriftliche Vereinbarung entschädigt.

c) Anteilsklasse «I-X» 0.000% p.a.

Die durch den Anleger zu tragenden Kosten im Zusammenhang mit den für die Anteilsklasse «I-X» zu erbringenden Leistungen werden über eine von UBS mit dem Anleger individuell ausgehandelte schriftliche Vereinbarung entschädigt (maximal 1.3% des Nettoinventarwertes - vgl. § 6 Ziff. 4).

d) Anteilsklasse «U-X» 0.000%p.a.

Die durch den Anleger zu tragenden Kosten im Zusammenhang mit den für die Anteilsklasse «U-X» zu erbringenden Leistungen werden über eine von UBS mit dem Anleger individuell ausgehandelte schriftlichen Vereinbarung entschädigt (maximal 1.3% des Nettoinventarwertes - vgl. § 6 Ziff. 4).

e) Anteilsklasse «Q»

Für die Anteilsklasse gilt eine Kommission von maximal 1.3%.»

7. Verwendung des Erfolgs (§ 22)

Folgende Bestimmung soll unter einer neuen Ziff. 3 ergänzt werden:

«Auf eine Thesaurierung resp. Ausschüttung kann verzichtet und der gesamte Nettoertrag kann auf neue Rechnung vorge-tragen werden, wenn:

– der Nettoertrag des laufenden Geschäftsjahres und die vorgetragenen Erträge aus früheren Rechnungs-jahren der kollektiven Kapitalanlage oder einer Anteilskasse weniger als 1% des Nettoinventarwerts der kollektiven Kapitalan-lage oder der Anteilsklasse beträgt, und

– der Nettoertrag des laufenden Geschäftsjahres und die vorgetragenen Erträge aus früheren Rechnungs-jahren der kollektiven Kapitalanlage oder einer Anteilsklasse weniger als eine Einheit der Rechnungseinheit der kollektiven Kapi-talanlagen bzw. der Anteilsklasse beträgt.»

8. Laufzeit der Teilvermögen und Auflösung (§ 26)

Folgende Bestimmung soll unter Ziff. 2 ergänzt werden:

«Die Fondsleitung oder die Depotbank können die Auflösung einzelner Teilvermögen durch Kündigung des Fondsvertrages fristlos herbeiführen.

Für das Teilvermögen «UBS (CH) Institutional Fund 3 – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II» gilt folgendes:

Das Teilvermögen dient als Zielfonds für die Teilvermögen «PF Pension – ESG 25 Fund», «PF Pension – ESG 50 Fund» (Dachfonds):

Der Dachfonds «PF Pension – ESG 25 Fund» darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften bis zu 45% der Anteile dieses Zielfonds erwerben.

Der Dachfonds «PF Pension – ESG 50 Fund» darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften bis zu 49% der Anteile dieses Zielfonds erwerben.

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch einen Dachfonds ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die Rückgabe durch den Dachfonds zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme

durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung an den Dachfonds wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen.»

Die Fondsvertragsänderungen wurden am 10. Mai 2023 von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA genehmigt. Die Änderungen traten am 12. Mai 2023 in Kraft.

Mitteilung vom 1. März 2024

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

Der Vermögensverwalter des Teilvermögens «– Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II» und «– Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II», UBS Asset Management (Americas) Inc., Chicago, USA, ändert seine Rechtsform und heisst ab 1. März 2024 UBS Asset Management (Americas) LLC, New York, USA. Der Sitzwechsel von Chicago nach New York wurde bereits am 31. März 2011 vorgenommen. UBS Asset Management (UK) Ltd, London, bleibt als weiterer Vermögensverwalter unverändert bestehen.

2. Weitere Änderungen

Es sollen weitere Änderungen vorgenommen werden, welche rein formeller bzw. redaktioneller Natur sind.

Die Fondsvertragsänderungen wurden am 26. März 2024 von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA genehmigt. Die Änderungen traten am 26. März 2024 in Kraft.

I. Vereinigung von UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II und UBS (CH) Investment Fund – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive

UBS Fund Management (Switzerland) AG als Fondsleitung beabsichtigt UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II («übertragendes Teilvermögen») und UBS (CH) Investment Fund – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive («übernehmendes Teilvermögen») am 6. Mai 2024 per 3. Mai 2024 zu vereinigen. UBS Switzerland AG als Depotbank hat sich mit dem Vorgehen einverstanden erklärt.

II. Vereinigung von UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II und UBS (CH) Investment Fund – Bonds CHF Inland Medium Term Passive

UBS Fund Management (Switzerland) AG als Fondsleitung beabsichtigt UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II («übertragendes Teilvermögen») mit UBS (CH) Investment Fund – Bonds CHF Inland Medium Term Passive («übernehmendes Teilvermögen») am 29. April 2024 per 26. April 2024 zu vereinigen. UBS Switzerland AG als Depotbank hat sich mit dem Vorgehen einverstanden erklärt.

III. Vereinigung von UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II und UBS (CH) Equity Fund – Switzerland Sustainable (CHF)

UBS Fund Management (Switzerland) AG als Fondsleitung beabsichtigt UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II («übertragendes Teilvermögen») und UBS (CH) Equity Fund – Switzerland Sustainable (CHF) («übernehmendes Teilvermögen») am 8. Mai 2024 per 7. Mai 2024 zu vereinigen. UBS Switzerland AG als Depotbank hat sich mit dem Vorgehen einverstanden erklärt.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|-------------------------------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 5 065 231 790.17 | 3 966 450 482.45 | 3 991 141 159.53 |
| Klasse I-A1 | CH0042114261 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 823.99 | 1 644.59 | 1 878.49 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 64 505,2690 | 59 480,1710 | 66 921,4020 |
| Klasse I-A2 | CH0257359726 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 499.12 | 1 351.68 | 1 543.91 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 33 646,4070 | 42 984,8170 | 51 502,8830 |
| Klasse I-A3 | CH0487119098 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 134.78 | 1 022.97 | 1 168.21 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 849 355,9390 | 665 729,7080 | 551 015,5650 |
| Klasse I-B | CH0042114337 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 869.32 | 1 683.35 | 1 920.25 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 36 039,6960 | 36 017,9360 | 37 660,4900 |
| Klasse I-X | CH0042114378 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 878.55 | 1 690.73 | 1 928.13 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 2 057 932,7970 | 1 815 113,8610 | 1 592 160,0910 |

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|-----------------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-A1 | CHF | 11.5% | -12.0% | 2.3% |
| Klasse I-A2 | CHF | 11.5% | -12.0% | 2.3% |
| Klasse I-A3 | CHF | 11.5% | -12.0% | 2.3% |
| Klasse I-B | CHF | 11.6% | -11.9% | 2.4% |
| Klasse I-X | CHF | 11.7% | -11.9% | 2.5% |
| Benchmark: | | | | |
| SXI Real Estate® Funds Broad (TR) | CHF | 11.7% | -11.9% | 2.4% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Emittenten in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--|--------------|
| UBS (CH) Property Fund – Swiss Mixed Sima | 16,86 |
| Credit Suisse Real Estate Fund Siat | 6,11 |
| UBS (CH) Property Fund – Swiss Residential Anfos | 5,11 |
| Credit Suisse Real Estate Fund LivingPlus | 5,06 |
| Credit Suisse Real Estate Fund Green Proprety | 4,06 |
| Rothschild Real Estate Sicav Swiss | 3,92 |
| Immofonds Schweiz Immobilien-Anlagefonds | 3,27 |
| Swiss Life REF (CH) Swiss Properties | 3,25 |
| UBS (CH) Property Fund – Leman Residential 'Foncipars' | 3,20 |
| La Fonciere Fonds Suisse De Placements Immobiliers | 3,05 |
| Übrige | 45,78 |
| TOTAL | 99,67 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Aufteilung nach Branchen in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------|--------------|
| Anlagefonds | 99,67 |
| TOTAL | 99,67 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-------------------------|-------------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 3 182 245.45 | 3 984 123.40 |
| Effekten | | |
| – Aktien und andere Beteiligungspapiere | 52 161 619.42 | 220 836 422.68 |
| – Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 4 997 069 639.75 | 3 739 624 416.10 |
| Sonstige Vermögenswerte | 13 616 519.03 | 11 881 766.63 |
| Gesamtfondsvermögen | 5 066 030 023.65 | 3 976 326 728.81 |
| Aufgenommene Kredite | -564 137.03 | -9 690 057.85 |
| Andere Verbindlichkeiten | -234 096.45 | -186 188.51 |
| Nettofondsvermögen | 5 065 231 790.17 | 3 966 450 482.45 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 18 646.20 | 1 993.60 |
| Negativzinsen | -7 000.50 | -11 376.10 |
| Rabatte und Retrozessionen | 0.00 | 98 938.06 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren | 3 582 120.43 | 4 781 344.88 |
| – aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen | 109 511 910.16 | 90 706 742.92 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 19 416 084.91 | 14 525 233.91 |
| TOTAL Ertrag | 132 521 761.20 | 110 102 877.27 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | -119 781.52 | -63 994.13 |
| Prüfaufwand | -14 684.90 | -14 684.90 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1 | -187 860.71 | -179 787.97 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2 | -104 350.93 | -125 843.20 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A3 | -1 211 267.54 | -1 015 837.65 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | -34 039.23 | -35 149.36 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-A1 ¹ | 200 536.72 | 185 481.07 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-A2 ¹ | 85 970.44 | 110 165.29 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-A3 ¹ | 1 465 338.91 | 1 151 514.97 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-B ¹ | 37 344.84 | 37 220.26 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-X ¹ | 188 391.51 | 154 155.31 |
| Sonstige Aufwendungen | -112 940.46 | -194 869.59 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -11 255 008.61 | -8 335 399.65 |
| TOTAL Aufwand | -11 062 351.48 | -8 327 029.55 |
| Nettoertrag | 121 459 409.72 | 101 775 847.72 |

| | | |
|---|-----------------------|------------------------|
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -5 949 772.65 | 3 534 955.99 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-A1 ¹ | -200 536.72 | -185 481.07 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-A2 ¹ | -85 970.44 | -110 165.29 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-A3 ¹ | -1 465 338.91 | -1 151 514.97 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-B ¹ | -37 344.84 | -37 220.26 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse I-X ¹ | -188 391.51 | -154 155.31 |
| Realisierter Erfolg | 113 532 054.65 | 103 672 266.81 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 390 662 652.27 | -588 818 054.84 |
| Gesamterfolg | 504 194 706.92 | -485 145 788.03 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 121 459 409.72 | 101 775 847.72 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 121 459 409.72 | 101 775 847.72 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | -23 771 442.82 | -19 803 676.26 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -97 687 966.90 | -81 972 171.46 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-------------------------|-------------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 3 966 450 482.45 | 3 991 141 159.53 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -21 820 008.23 | -17 928 946.97 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | 616 406 609.03 | 478 384 057.92 |
| Gesamterfolg | 504 194 706.92 | -485 145 788.03 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 5 065 231 790.17 | 3 966 450 482.45 |

¹ Gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.8.3

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Klasse I-A1 | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 59 480,1710 | 66 921,4020 |
| Ausgegebene Anteile | 8 578,5880 | 8 063,2290 |
| Zurückgenommene Anteile | -3 553,4900 | -15 504,4600 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 64 505,2690 | 59 480,1710 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 5 025,0980 | -7 441,2310 |
| Klasse I-A2 | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 42 984,8170 | 51 502,8830 |
| Ausgegebene Anteile | 3 430,1000 | 5 197,1340 |
| Zurückgenommene Anteile | -12 768,5100 | -13 715,2000 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 33 646,4070 | 42 984,8170 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -9 338,4100 | -8 518,0660 |
| Klasse I-A3 | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 665 729,7080 | 551 015,5650 |
| Ausgegebene Anteile | 278 273,9860 | 167 468,2550 |
| Zurückgenommene Anteile | -94 647,7550 | -52 754,1120 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 849 355,9390 | 665 729,7080 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 183 626,2310 | 114 714,1430 |
| Klasse I-B | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 36 017,9360 | 37 660,4900 |
| Ausgegebene Anteile | 41,7600 | 372,4890 |
| Zurückgenommene Anteile | -20,0000 | -2 015,0430 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 36 039,6960 | 36 017,9360 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 21,7600 | -1 642,5540 |
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 1 815 113,8610 | 1 592 160,0910 |
| Ausgegebene Anteile | 560 597,2350 | 489 858,0720 |
| Zurückgenommene Anteile | -317 778,2990 | -266 904,3020 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 2 057 932,7970 | 1 815 113,8610 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 242 818,9360 | 222 953,7700 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Klasse I-A1

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 24.462 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -8.562 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 15.900 |

Klasse I-A2

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 19.833 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -6.942 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 12.891 |

Klasse I-A3

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 15.307 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -5.357 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 9.950 |

Klasse I-B

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 25.003 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -8.751 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 16.252 |

Klasse I-X

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 25.156 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -8.805 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 16.351 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung) ohne VSt-Abzug¹

| Klasse I-A1 | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 19.301 |
| Klasse I-A2 | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 16.066 |
| Klasse I-A3 | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 11.936 |
| Klasse I-B | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 19.795 |
| Klasse I-X | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 19.875 |

¹ Dividenden aus Fonds mit direktem Grundbesitz

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Investmentzertifikate, closed end | | | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | | | |
| PROCIMMO REAL ESTATE SICAV - SWISS COMMERCIAL FUND II-SHS* | CHF | 287 244 | 37 933 | 325 177 | | | | |
| SF COMMERCIAL PROPERTIES FUND-DISTRIBUTIVE* | CHF | 174 036 | 36 936 | 11 357 | 199 615 | 15 609 893 | 0,31 | |
| STREETBOX REAL ESTATE FUND-DISTRIBUTIVE* | CHF | 31 149 | 6 473 | 1 894 | 35 728 | 17 220 896 | 0,34 | |
| SUISSE ROMANDE PROPERTY FUND-DISTRIBUTIVE* | CHF | 195 156 | 40 246 | 12 183 | 223 219 | 19 196 834 | 0,38 | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 52 027 623 | 1,03 | |
| Total Investmentzertifikate, closed end | | | | | | 52 027 623 | 1,03 | |

Investmentzertifikate, open end

Schweiz

| | | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|---------|-----------|----------------------|--------------|--|
| BALOISE SWISS PROPERTY FUND-DISTRIBUTIVE* | CHF | 454 393 | 264 747 | 120 291 | 598 849 | 71 263 031 | 1,41 | |
| BONHOTE - IMMOBILIER* | CHF | 529 346 | 126 851 | 42 128 | 614 069 | 91 496 281 | 1,81 | |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND INTERSWISS* | CHF | 654 976 | 140 151 | 58 207 | 736 920 | 131 908 680 | 2,60 | |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND SIAT* | CHF | 1 197 941 | 272 084 | 107 296 | 1 362 729 | 309 339 483 | 6,11 | |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS* | CHF | 1 520 615 | 346 700 | 134 857 | 1 732 458 | 256 403 784 | 5,06 | |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPRETY* | CHF | 1 433 671 | 322 121 | 124 906 | 1 630 886 | 205 491 636 | 4,06 | |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY* | CHF | 617 749 | 133 007 | 44 087 | 706 669 | 52 434 840 | 1,04 | |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICSPLUS-CHF-DIST* | CHF | 580 973 | 129 101 | 45 475 | 664 599 | 69 118 296 | 1,36 | |
| CRONOS IMMO FUND-UNITS* | CHF | 443 964 | 150 723 | 31 156 | 563 531 | 63 115 472 | 1,25 | |
| DOMINICE SWISS PROPERTY FUND-DIST-CHF* | CHF | 218 150 | 45 196 | 14 162 | 249 184 | 31 770 960 | 0,63 | |
| FIDFUND RESIDENTIA - CHF* | CHF | 116 036 | 23 688 | 7 109 | 132 615 | 13 791 960 | 0,27 | |
| FIR FONDS IMMOBILIER ROMAND* | CHF | 555 602 | 122 568 | 44 882 | 633 288 | 139 956 648 | 2,76 | |
| GOOD BUILDINGS SWISS REAL ESTATE FUND-ANTEILE* | CHF | 159 976 | 32 692 | 9 933 | 182 735 | 24 943 328 | 0,49 | |
| HELVETICA SWISS COMMERCIAL-DIST* | CHF | 315 797 | 65 553 | 20 627 | 360 723 | 27 775 671 | 0,55 | |
| IMMO HELVETIC* | CHF | 406 682 | 90 759 | 32 221 | 465 220 | 100 487 520 | 1,98 | |
| IMMOFONDS SCHWEIZ.IMMOBILIEN-ANLAGEFONDS* | CHF | 255 515 | 58 175 | 21 968 | 291 722 | 165 698 096 | 3,27 | |
| LA FONCIERE FONDS SUISSE DE PLACEMENTS IMMOBILIERS* | CHF | 991 250 | 223 413 | 84 165 | 1 130 498 | 154 312 977 | 3,05 | |
| PATRIMONIUM REAL ESTATE FDS - PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE* | CHF | 415 475 | 91 505 | 31 700 | 475 280 | 82 223 440 | 1,62 | |
| PROCIMMO RESIDENTIAL LEMANIC FUND- UNITS* | CHF | 189 800 | 38 987 | 11 986 | 216 801 | 30 460 541 | 0,60 | |
| PROCIMMO SWISS COMMERCIAL FUND* | CHF | 432 923 | 378 762 | 42 522 | 769 163 | 112 297 798 | 2,22 | |
| REALSTONE SWISS PROPERTY* | CHF | 977 256 | 219 708 | 82 473 | 1 114 491 | 143 769 339 | 2,84 | |
| ROTH RE SWISS-A* | CHF | 1 171 243 | 260 151 | 99 035 | 1 332 359 | 198 521 491 | 3,92 | |
| SCHRODER IMMOPLUS* | CHF | 778 114 | 173 884 | 64 742 | 887 256 | 141 517 332 | 2,79 | |
| SF RETAIL PROPERTIES FUND-ANTEILE* | CHF | 441 176 | 130 109 | 32 959 | 538 326 | 58 139 208 | 1,15 | |
| SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND* | CHF | 661 473 | 301 843 | 264 116 | 699 200 | 85 652 000 | 1,69 | |
| SOLVALOR 61 FONDS DE PLACEMENT IMMOBILIER* | CHF | 367 779 | 82 941 | 30 003 | 420 717 | 123 270 081 | 2,43 | |
| SWISS LIFE REF (CH) SWISS PROPERTIES-ANTEILE* | CHF | 1 180 472 | 265 355 | 100 014 | 1 345 813 | 164 862 093 | 3,25 | |
| SWISSCANTO (CH) REAL ESTATE FUND IFCA* | CHF | 766 942 | 171 959 | 63 854 | 875 047 | 149 195 514 | 2,95 | |
| SWISSCANTO (CH) REAL ESTATE FD SWISS COMM-FA CHF-ANTEILE* | CHF | 377 796 | 80 302 | 25 892 | 432 206 | 44 733 321 | 0,88 | |
| SWISSINVEST REAL ESTATE FUND* | CHF | 385 432 | 83 554 | 29 857 | 439 129 | 85 191 026 | 1,68 | |
| UBS (CH) PROP FUND - SWISS RESIDENTIAL 'ANFOS'* | CHF | 2 593 504 | 586 259 | 229 499 | 2 950 264 | 259 033 179 | 5,11 | |
| UBS (CH) PROP FUND - LEMAN RESIDENTIAL 'FONCIPARS'* | CHF | 1 037 952 | 234 435 | 88 465 | 1 183 922 | 162 197 314 | 3,20 | |
| UBS (CH) PROP FUND - SWISS MIXED 'SIMA'* | CHF | 5 231 338 | 1 198 953 | 479 345 | 5 950 946 | 853 960 751 | 16,86 | |
| UBS (CH) PROP FUND - SWISS COMMERCIAL 'SWISSREAL'* | CHF | 1 796 384 | 399 827 | 149 264 | 2 046 947 | 135 098 502 | 2,67 | |
| UBS (CH) PROP FUND - DIRECT RESIDENTIAL* | CHF | 3 374 401 | 749 244 | 263 525 | 3 860 120 | 76 816 388 | 1,52 | |
| UBS (CH) PROP FUND - DIRECT URBAN* | CHF | 2 617 463 | 554 502 | 178 116 | 2 993 849 | 39 668 499 | 0,78 | |
| ZURICH INV AG-ZIF IMMOBILIEN DIREKT SCHWEIZ-REGISTERED UNITS* | CHF | | 813 344 | 15 483 | 797 861 | 91 355 085 | 1,80 | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 4 947 271 563 | 97,66 | |
| Total Investmentzertifikate, open end | | | | | | 4 947 271 563 | 97,66 | |

Anrechte

Schweiz

| | | | | | | | | |
|---|-----|----|---------|---------|---------|----------------------|--------------|--|
| BALOISE SWISS PROPERTY FUND RIGHTS 23-29.08.23* | CHF | | 487 922 | 487 922 | | | | |
| CRONOS IMMO FUND RIGHTS 24-04.03.24* | CHF | | 528 033 | 528 033 | | | | |
| CRONOS IMMO FUND- RIGHTS 22.03.23* | CHF | 19 | | 19 | | | | |
| DOMINICE SWISS PROPERTY FUND CALL RIGHTS 28.03.24* | CHF | | 249 184 | | 249 184 | 88 460 | 0,00 | |
| PROCIMMO REAL ESTATE SICAV-SWISS COMMER FD RIGHTS 28.03.24* | CHF | | 769 031 | | 769 031 | 45 287 | 0,00 | |
| SF RETAIL PROPERTIES FD RIGHTS 15.03.24* | CHF | | 504 044 | 503 511 | 533 | 249 | 0,00 | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 133 996 | 0,00 | |
| Total Anrechte | | | | | | 133 996 | 0,00 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 4 999 433 182 | 98,69 | |

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|----------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | | | |
| Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | | | | |
| Investmentzertifikate, open end | | | | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | | | | |
| SWISS CENTRAL CITY REAL ESTATE FUND-CHF** | CHF | 276 474 | 57 279 | 17 948 | 315 805 | 23 685 375 | 0,47 | | |
| VONTOBEL SUSTAINABLE REAL ESTATE SWITZERLAND-CHF** | CHF | | 295 471 | 12 866 | 282 605 | 26 112 702 | 0,52 | | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 49 798 077 | 0,98 | | |
| Total Investmentzertifikate, open end | | | | | | 49 798 077 | 0,98 | | |
| Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 49 798 077 | 0,98 | | |
| Total Wertschriften | | | | | | 5 049 231 259 | 99,67 | | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | 0,00 | | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 3 182 245 | 0,06 | | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 13 616 520 | 0,27 | | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 5 066 030 024 | 100,00 | | |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | | -564 137 | | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | | -234 097 | | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | | 5 065 231 790 | | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 4 999 433 182 | 98,69 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | 49 798 077 | 0,98 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 5 049 231 259 | 99,67 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Einzahlung in Effekten statt in bar

UBS (CH) Institutional Fund 3
– *Swiss Real Estate Securities Selection Passive II Klasse I-X*
Während der Berichtsperiode wurden Effekten (statt in bar) im Gegenwert von 416 196 168,75 CHF eingebracht, was 240 455,4620 Anteilen entspricht.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

Zusammengesetzte TER für die letzten 12 Monate:

| | |
|--|-------|
| <i>UBS (CH) Institutional Fund 3</i> | |
| – <i>Swiss Real Estate Securities Selection Passive II</i> | |
| <i>Klasse I-A1</i> | 0,91% |
| <i>Klasse I-A2</i> | 0,91% |
| <i>Klasse I-A3</i> | 0,89% |
| <i>Klasse I-B</i> | 0,78% |
| <i>Klasse I-X</i> | 0,73% |

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – CHF Exposure

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|--|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 319 889 442.93 | 343 781 027.72 | 329 000 358.30 |
| Klasse I-X | CH0043947545 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 217.12 | 1 131.81 | 1 194.60 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 1 217.12 | 1 136.68 | 1 198.66 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 262 825,7570 | 303 745,1060 | 275 406,7160 |

¹ siehe Ergänzende Angaben

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|----------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-X | CHF | 7.4% | -4.9% | -5.8% |
| Benchmark: | | | | |
| SBI® Domestic AAA-BBB (TR) | CHF | 6.6% | -5.5% | -6.9% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------|--------------|
| Schweiz | 99,57 |
| TOTAL | 99,57 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 898 863.50 | 558 382.06 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 3 004 350.00 | 2 701 620.00 |
| – Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 315 521 703.15 | 339 576 538.21 |
| Sonstige Vermögenswerte | 464 526.28 | 944 487.45 |
| Gesamtfondsvermögen | 319 889 442.93 | 343 781 027.72 |
| Nettofondsvermögen | 319 889 442.93 | 343 781 027.72 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 2 992.64 | 1 655.63 |
| Negativzinsen | -1 053.40 | -4 151.37 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 34 828.16 | 46 072.42 |
| – aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen | 2 935 475.79 | 2 571 546.51 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 231 287.24 | 22 342.90 |
| TOTAL Ertrag | 3 203 530.43 | 2 637 466.09 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | 0.00 | -6.82 |
| Prüfaufwand | -9 299.90 | -14 146.40 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -2 938.90 | -559.49 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -501 915.02 | -11 265.54 |
| TOTAL Aufwand | -514 153.82 | -25 978.25 |
| Nettoertrag | 2 689 376.61 | 2 611 487.84 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -5 747 698.46 | -4 441 942.73 |
| Realisierter Erfolg | -3 058 321.85 | -1 830 454.89 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 28 248 843.81 | -15 379 893.58 |
| Gesamterfolg | 25 190 521.96 | -17 210 348.47 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|---------------------|---------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 2 689 376.61 | 2 611 487.84 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 2 689 376.61 | 2 611 487.84 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | -941 281.81 | -914 020.74 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -1 748 094.80 | -1 697 467.10 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 343 781 027.72 | 329 000 358.30 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -901 560.99 | -907 052.66 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | -48 180 545.76 | 32 898 070.55 |
| Gesamterfolg | 25 190 521.96 | -17 210 348.47 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 319 889 442.93 | 343 781 027.72 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 303 745,1060 | 275 406,7160 |
| Ausgegebene Anteile | 37 035,7790 | 77 085,7530 |
| Zurückgenommene Anteile | -77 955,1280 | -48 747,3630 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 262 825,7570 | 303 745,1060 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -40 919,3490 | 28 338,3900 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

| Klasse I-X | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 10.232 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -3.581 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 6.651 |

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Anleihen, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 12-11.06.24* | CHF | 2 700 000 | | 450 000 | 2 250 000 | 2 249 100 | 0,70 |
| SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 13-24.07.25* | CHF | | 750 000 | | 750 000 | 755 250 | 0,24 |
| TOTAL CHF | | | | | 3 004 350 | 0,94 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | 3 004 350 | 0,94 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 3 004 350 | 0,94 | |

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

Investmentzertifikate, open end

Global

| | | | | | | | |
|--|-----|----|--|--|----|--------------|-------------|
| UBS (CH) MONEY MARKET FUND - CHF I-X** | CHF | 10 | | | 10 | 8 641 | 0,00 |
| TOTAL Global | | | | | | 8 641 | 0,00 |

Schweiz

| | | | | | | | |
|---|-----|-------|-----|-----|-------|--------------------|---------------|
| UBS (CH) INST FUND - BONDS CHF INLAND U-X** | CHF | 3 759 | 372 | 882 | 3 249 | 315 513 063 | 98,63 |
| UBS (CH) INSTITUTIONAL FUND 3 - BONDS CHF INLAND II U-X** | CHF | 2 | | 2 | | | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 315 513 063 | 98,63 |
| Total Investmentzertifikate, open end | | | | | | 315 521 703 | 98,63 |
| Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 315 521 703 | 98,63 |
| Total Wertschriften | | | | | | 318 526 053 | 99,57 |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | 0,00 |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 898 864 | 0,28 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 464 526 | 0,15 |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 319 889 443 | 100,00 |

Nettofondsvermögen

319 889 443

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 3 004 350 | 0,94 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | 315 521 703 | 98,63 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 318 526 053 | 99,57 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

*Zusammengesetzte TER für die letzten 12 Monate:
UBS (CH) Institutional Fund 3 – CHF Exposure
Klasse I-X*

0,00%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

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

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|--|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 174 688 821.55 | 144 208 104.40 | 239 454 053.95 |
| Klasse I-A1 | CH0126480547 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 659.46 | 693.27 | 781.24 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 659.59 | 693.34 | 781.08 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 22 844,2620 | 24 459,3180 | 24 775,6830 |
| Klasse I-B | CH0126480554 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 684.66 | 716.55 | 804.93 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 684.80 | 716.62 | 804.77 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 3 036,0090 | 2 570,4110 | 3 597,4110 |
| Klasse I-X | CH0126480562 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 689.15 | 720.71 | 807.90 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 689.29 | 720.78 | 807.74 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 228 607,8530 | 174 007,4070 | 268 848,8660 |

¹ siehe Ergänzende Angaben

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|--|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-A1 | CHF | -4.9% | -11.2% | 47.8% |
| Klasse I-B | CHF | -4.3% | -10.7% | 48.7% |
| Klasse I-X | CHF | -4.3% | -10.7% | 48.8% |
| Benchmark: | | | | |
| UBS Bloomberg BCOM Constant Maturity Composite Hedged CHF Total Return | CHF | -3.7% | -10.0% | 49.6% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------------|--------------|
| Schweiz | 43,00 |
| Niederlande | 10,48 |
| Frankreich | 9,50 |
| Deutschland | 5,08 |
| Kanada | 3,39 |
| Vereinigte Staaten | 3,38 |
| Supranational | 2,83 |
| Österreich | 2,00 |
| Dänemark | 1,70 |
| Australien | 1,70 |
| Übrige | 9,28 |
| TOTAL | 92,34 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 9 992 135.03 | 16 742 817.96 |
| Geldmarktinstrumente | 113 743 867.76 | 86 363 176.43 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 49 093 172.00 | 39 540 497.50 |
| Derivative Finanzinstrumente | 3 036 422.15 | 1 252 416.49 |
| Sonstige Vermögenswerte | 480 833.06 | 318 675.15 |
| Gesamtfondsvermögen | 176 346 430.00 | 144 217 583.53 |
| Aufgenommene Kredite | -1 650 000.42 | -9.60 |
| Andere Verbindlichkeiten | -7 608.03 | -9 469.53 |
| Nettofondsvermögen | 174 688 821.55 | 144 208 104.40 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 139 744.02 | 31 251.24 |
| Negativzinsen | -29 374.89 | -79 250.62 |
| Erträge der Geldmarktinstrumente | 1 459 726.29 | 0.00 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 428 609.96 | 410 741.83 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 99 894.09 | -44 872.71 |
| TOTAL Ertrag | 2 098 599.47 | 317 869.74 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | -14 399.14 | -12 657.65 |
| Prüfaufwand | -16 300.40 | -14 146.40 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1 | -96 280.79 | -113 174.06 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | -870.48 | -1 170.49 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -2 848.90 | -628.19 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -78 119.67 | 96 433.53 |
| TOTAL Aufwand | -208 819.38 | -45 343.26 |
| Nettoertrag | 1 889 780.09 | 272 526.48 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹ | -10 438 120.28 | -18 185 976.92 |
| Realisierter Erfolg | -8 548 340.19 | -17 913 450.44 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 2 449 236.05 | 3 852 303.69 |
| Gesamterfolg | -6 099 104.14 | -14 061 146.75 |

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

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|---------------------|--------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 1 889 780.09 | 272 526.48 |
| Übertrag auf das Kapital ¹ | 0.00 | 74 399.47 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 1 889 780.09 | 346 925.95 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | -661 423.03 | -121 424.08 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -1 228 357.06 | -225 501.87 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 144 208 104.40 | 239 454 053.95 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -163 720.18 | -127 478.98 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | 36 743 541.47 | -81 057 323.82 |
| Gesamterfolg | -6 099 104.14 | -14 061 146.75 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 174 688 821.55 | 144 208 104.40 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| | Anzahl | Anzahl |
| Klasse I-A1 | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 24 459,3180 | 24 775,6830 |
| Ausgegebene Anteile | 2 799,8880 | 565,0830 |
| Zurückgenommene Anteile | -4 414,9440 | -881,4480 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 22 844,2620 | 24 459,3180 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -1 615,0560 | -316,3650 |
| Klasse I-B | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 2 570,4110 | 3 597,4110 |
| Ausgegebene Anteile | 465,5980 | 0,0000 |
| Zurückgenommene Anteile | 0,0000 | -1 027,0000 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 3 036,0090 | 2 570,4110 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 465,5980 | -1 027,0000 |
| Klasse I-X | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 174 007,4070 | 268 848,8660 |
| Ausgegebene Anteile | 75 193,7140 | 21 636,9820 |
| Zurückgenommene Anteile | -20 593,2680 | -116 478,4410 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 228 607,8530 | 174 007,4070 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 54 600,4460 | -94 841,4590 |

¹ Umbuchung des Verlustes der Klasse I-A1 gemäss EstV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20. November 2017 Ziffer 2.9.4 in Verbindung mit Art. 29 VStV.

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Klasse I-A1

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|--------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 3.384 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -1.184 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 2.200 |

Klasse I-B

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|--------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 7.469 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -2.614 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 4.855 |

Klasse I-X

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|--------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 7.829 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -2.740 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 5.089 |

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Notes, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| CAISSE DE REFINANCE DE L'HABITAT-REG-S 2.37500% 12-05.03.24* | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| EBN BV-REG-S 1.12500% 12-04.07.24* | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | 2 995 800 | 1,70 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.12500% 12-26.04.23* | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | |
| TOTAL CHF | | | | | 2 995 800 | 1,70 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | 2 995 800 | 1,70 | |

Notes, Nullcoupon

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|---------|--|-------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-16.08.23* | CHF | 750 000 | | 750 000 | | | |
| TOTAL CHF | | | | | | 0,00 | |
| Total Notes, Nullcoupon | | | | | | 0,00 | |

Medium-Term Notes, fester Zins

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|-----------|-------------------|--------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| ABN AMRO BANK NV 1.50000% 12-18.07.23* | CHF | 2 500 000 | | 2 500 000 | | | |
| ABN AMRO BANK NV-REG-S 0.30000% 16-18.12.24* | CHF | | 1 700 000 | 1 700 000 | 1 686 570 | 0,96 | |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.36600% 18-10.10.24* | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | 2 981 100 | 1,69 | |
| BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24* | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | 2 985 300 | 1,69 | |
| BNG BANK NV 1.12500% 13-19.04.23* | CHF | 3 340 000 | | 3 340 000 | | | |
| BNG BANK NV-REG-S 1.25000% 14-30.04.24* | CHF | | 5 820 000 | 5 820 000 | 5 818 254 | 3,30 | |
| CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 2.37500% 11-19.04.23* | CHF | 2 535 000 | | 2 535 000 | | | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.15000% 18-31.07.23* | CHF | 2 095 000 | | 2 095 000 | | | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.62500% 15-15.09.23* | CHF | 2 290 000 | | 2 290 000 | | | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.30000% 17-18.04.24* | CHF | | 1 800 000 | 1 800 000 | 1 798 920 | 1,02 | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE BV-REG-S 1.50000% 12-21.02.24* | CHF | | 3 730 000 | 3 730 000 | | | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.37500% 13-24.07.23* | CHF | 4 000 000 | | 4 000 000 | | | |
| DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24* | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | |
| EBN BV-REG-S 1.62500% 11-03.10.23* | CHF | 3 000 000 | 4 000 000 | 7 000 000 | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.50000% 12-02.08.24* | CHF | | 4 990 000 | 4 990 000 | 4 990 998 | 2,83 | |
| EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.38250% 18-11.07.24* | CHF | | 1 000 000 | 1 000 000 | 996 300 | 0,56 | |
| LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB 1.12500% 13-11.04.23* | CHF | 4 000 000 | | 4 000 000 | | | |
| MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.75000% 14-17.09.24* | CHF | | 1 400 000 | 1 400 000 | 1 395 380 | 0,79 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.50000% 14-07.02.24* | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | |
| SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.25000% 13-17.07.23* | CHF | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24* | CHF | | 6 000 000 | 6 000 000 | 5 987 400 | 3,40 | |
| WESTPAC BANKING CORP 0.40000% 15-09.06.23* | CHF | 4 000 000 | | 4 000 000 | | | |
| WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON-REG-S 0.37500% 16-05.02.24* | CHF | | 6 400 000 | 6 400 000 | | | |
| TOTAL CHF | | | | | 28 640 222 | 16,24 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | 28 640 222 | 16,24 | |

Anleihen, fester Zins

| | | | | | | | |
|--|-----|--|-----------|-----------|-------------------|-------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24* | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | 2 980 200 | 1,69 | |
| NESTLE SA-REG-S 0.25000% 18-28.06.24* | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | 2 991 000 | 1,70 | |
| OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG-REG-S 2.62500% 06-22.11.24* | CHF | | 3 500 000 | 3 500 000 | 3 528 000 | 2,00 | |
| ZURICH INSURANCE CO-REG-S 0.50000% 18-18.12.24* | CHF | | 3 500 000 | 3 500 000 | 3 476 200 | 1,97 | |
| TOTAL CHF | | | | | 12 975 400 | 7,36 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | 12 975 400 | 7,36 | |

| Titel | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| Anleihen, Nullcoupon | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.00000% 16-16.05.23* | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24* | CHF | | 2 500 000 | 2 500 000 | 2 487 750 | 1,41 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 15-25.07.23* | CHF | 3 600 000 | | 3 600 000 | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-14.06.24* | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | 1 994 000 | 1,13 | |
| TOTAL CHF | | | | | 4 481 750 | 2,54 | |
| Total Anleihen, Nullcoupon | | | | | 4 481 750 | 2,54 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 49 093 172 | 27,84 | |

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

Euro-Commercial-Papers, Nullcoupon

| | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|--|--|-------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| AGENCE CENTRALE ORGANISMES ECP 0.00000% 21.10.22-25.04.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| TOTAL CHF | | | | | | 0,00 | |
| Total Euro-Commercial-Papers, Nullcoupon | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 0,00 | |

Nicht-Effekten

Euro-Depositenzertifikate, Nullcoupon

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|-----------|-------------------|--------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| ABN AMRO BANK NV ECD 0.00000% 06.11.23-04.03.24** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | |
| ABN AMRO BANK NV ECD 0.00000% 04.03.24-04.06.24** | CHF | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 994 988 | 1,13 | |
| BANK OF MONTREAL/LONDON ECD 0.00000% 12.06.23-06.12.23** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | |
| BANK OF MONTREAL/LONDON ECD 0.00000% 06.12.23-06.06.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 992 262 | 1,70 | |
| CREDIT AGRICOLE SAVLONDON ECD 0.00000% 15.09.23-15.03.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| DNB BANK ASA ECD 0.00000% 27.11.23-28.05.24** | CHF | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 995 380 | 1,13 | |
| GOLDMAN SACHS INTL-REG-S ECD 0.00000% 11.03.24-12.08.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 983 728 | 1,69 | |
| JYSKE BANK A/S ECD 0.00000% 03.08.23-14.09.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| JYSKE BANK A/S ECD 0.00000% 01.02.24-08.04.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 998 740 | 1,70 | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK ECD 0.00000% 15.11.22-15.05.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| MIZUHO BANK LTD/LONDON ECD 0.00000% 19.06.23-15.09.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| MIZUHO BANK LTD/LONDON ECD 0.00000% 15.09.23-17.11.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| MIZUHO BANK LTD/LONDON ECD 0.00000% 24.11.23-24.01.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| MIZUHO BANK LTD/LONDON ECD 0.00000% 25.01.24-24.04.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 996 909 | 1,70 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA/LON ECD 0.00000% 07.08.23-11.12.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| ROYAL BANK OF CANADA ECD 0.00000% 13.11.23-13.08.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 983 606 | 1,69 | |
| RYL BK CANADA(LON) ECD 0.00000% 10.05.22-09.05.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| TORONTO-DOMINION BANK ECD 0.00000% 09.06.23-11.12.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| TOTAL CHF | | | | | 18 945 613 | 10,74 | |
| Total Euro-Depositenzertifikate, Nullcoupon | | | | | 18 945 613 | 10,74 | |

Euro-Commercial-Papers, Nullcoupon

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|------|--|
| CHF | | | | | | | |
| AGENCE CENTRALE ORG SS-REG-S ECP 0.00000% 16.11.23-18.03.24** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| AGENCE CENTRALE ORG SS-REG-S ECP 0.00000% 18.03.24-17.05.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 994 315 | 1,70 | |
| AGENCE CENTRALE ORGANIS-REG-S ECP 0.00000% 09.06.23-09.08.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| AGENCE CENTRALE ORGANI-REG-S ECP 0.00000% 04.10.23-07.11.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GP ECP 0.00000% 14.03.23-14.09.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK GP ECP 0.00000% 11.10.23-11.04.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 998 470 | 1,70 | |
| BANQUE FEDEVE DU CREDIT ECP-REG-S 0.00000% 26.04.23-31.10.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| BAYERISCHE LANDESBANK-REG-S ECP 0.00000% 19.09.23-06.11.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| BAYERISCHE LANDESBANK ECP 0.00000% 07.02.24-08.07.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 988 139 | 1,69 | |
| BAYERISCHE LANDESBANK ECP 0.00000% 07.11.23-07.02.24** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | |
| BERLIN HYP AG-REG-S ECP 0.00000% 06.03.23-06.06.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| BERLIN HYP AG-REG-S ECP 0.00000% 03.08.23-07.09.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| BGL BNP PARIBAS SA ECP 0.00000% 20.01.23-20.07.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| BGL BNP PARIBAS SA ECP 0.00000% 15.03.24-19.06.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 990 829 | 1,70 | |
| BNP PARIBAS SA ECP 0.00000% 20.07.23-11.09.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| BNP PARIBAS SA ECP 0.00000% 11.09.23-11.03.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| BRED BANQUE POPULAIRE ECP 0.00000% 03.11.23-04.03.24** | CHF | 3 500 000 | 3 500 000 | | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal | |
| CAISSE DEPOTS & CONSIGN-REG-S ECP 0.00000% 21.04.23-18.08.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| CAISSE DEPOTS & CONSIGN-REG-S ECP 0.00000% 12.09.23-20.11.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA ECP 0.00000% 19.04.23-20.11.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| COOPERATIVE RABOBANK-REG-S ECP 0.00000% 08.11.22-08.05.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| COOPERATIVE RABOBANK-REG-S ECP 0.00000% 08.05.23-08.11.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| DNB BANK ASA ECP 0.00000% 13.06.23-08.08.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| DNB BANK ASA ECP 0.00000% 08.08.23-27.09.23** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | | |
| DZ PRIVATBANK SA-REG-S ECP 0.00000% 22.02.23-21.08.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| DZ PRIVATBANK SA-REG-S ECP 0.00000% 22.08.23-22.11.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| ERSTE ABWICKLUNGSAN-REG-S ECP 0.00000% 26.07.23-26.09.23** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | | |
| ERSTE ABWICKLUNGSAN-REG-S ECP 0.00000% 16.02.24-14.03.24** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| ING BANK NV-REG-S ECP 0.00000% 07.08.23-18.09.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| ING BANK NV-REG-S ECP 0.00000% 19.09.23-19.03.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| ING BANK NV-REG-S ECP 0.00000% 19.03.24-19.09.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 981 220 | 1,69 | | |
| JYSKE BANK A/S ECP 0.00000% 03.02.23-03.08.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| JYSKE BANK A/S ECP 0.00000% 01.11.23-18.01.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUF ECP 0.00000% 15.11.22-15.05.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUF ECP 0.00000% 24.07.23-13.09.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUF ECP 0.00000% 17.10.23-20.02.24** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | | |
| LA BANQUE POSTALE ECP 0.00000% 11.05.23-11.08.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LA BANQUE POSTALE ECP 0.00000% 11.08.23-13.11.23** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | | |
| LANDESBANK BADEN-WUERTEMBERG ECP 0.00000% 07.09.23-12.02.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LANDESBANK HESSEN ECP-REG-S 0.00000% 03.11.22-03.05.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LANDESBANK HESSEN-REG-S ECP 0.00000% 24.07.23-22.08.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LANDESBANK HESSEN-REG-S ECP 0.00000% 22.08.23-22.05.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 993 748 | 1,70 | | |
| LANDESKEDIT-WUERT BANK-REG-S ECP 0.00000% 26.04.23-26.09.23** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | | |
| LANDESKEDIT-WUERT BANK-REG-S ECP 0.00000% 14.09.23-16.10.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LANDWIRTSCHAFT RENTENBK-REG-S ECP 0.00000% 13.07.23-16.08.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBAN ECP 0.00000% 13.06.23-13.07.23** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | | |
| LANDWIRTSCHAFTLICHE REN-REG-S ECP 0.00000% 12.09.23-14.11.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| LANSFORSÅKRINGAR BANK AB ECP 0.00000% 11.04.23-11.10.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| MUNICIPALITY FINANCE-REG-S ECP 0.00000% 12.06.23-23.08.23** | CHF | 6 000 000 | 6 000 000 | | | | | |
| MUNICIPALITY FINANCE PL-REG-S ECP 0.00000% 23.08.23-24.11.23** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | | |
| MUNICIPALITY FINANCE PL-REG-S ECP 0.00000% 20.02.24-21.03.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK ECP 0.00000% 27.01.23-27.07.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK ECP 0.00000% 12.04.23-12.10.23** | CHF | 1 000 000 | 1 000 000 | | | | | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK ECP 0.00000% 27.07.23-11.09.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK ECP 0.00000% 14.09.23-16.10.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK ECP 0.00000% 05.12.23-05.04.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 999 084 | 1,70 | | |
| NRW BANK-REG-S ECP 0.00000% 16.06.23-19.09.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| OP CORPORATE BANK PLC ECP 0.00000% 24.02.23-24.08.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| OP CORPORATE BANK PLC ECP 0.00000% 25.08.23-26.02.24** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS ECP 0.00000% 09.03.23-21.04.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS ECP 0.00000% 19.04.23-21.07.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS ECP 0.00000% 21.07.23-21.09.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS ECP 0.00000% 21.09.23-22.01.24** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS ECP 0.00000% 22.01.24-22.04.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 997 138 | 1,70 | | |
| SANTANDER UK PLC-REG-S ECP 0.00000% 06.02.24-07.05.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 995 470 | 1,70 | | |
| SNCF-REG-S ECP 0.00000% 13.11.23-16.01.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| SOCIETE NATIONALE-REG-S ECP 0.00000% 15.05.23-12.09.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | | |
| SWEDBANK AB ECP 0.00000% 13.04.23-17.10.23** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | | |
| SWEDBANK AB-REG-S ECP 0.00000% 17.10.23-19.02.24** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | | |
| SWEDBANK AB-REG-S ECP 0.00000% 20.02.24-21.06.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 990 430 | 1,70 | | |
| TOTAL CHF | | | | | 29 928 842 | 16,97 | | |
| Total Euro-Commercial-Papers, Nullcoupon | | | | | 29 928 842 | 16,97 | | |

Treasury-Bills, Nullcoupon

CHF

| | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|------|--|
| SWISS NATIONAL BANK BILLS-REG-S TB 0.00000% 06.02.23-08.01.24** | CHF | 6 000 000 | 6 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S 0.00000% 12.12.22-13.11.23** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL TB-REG-S 0.00000% 13.02.23-08.05.23** | CHF | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S 0.00000% 27.02.23-22.05.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S 0.00000% 11.04.23-03.07.23** | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S 0.00000% 02.05.23-02.04.24** | CHF | 5 000 000 | | 5 000 000 | 5 000 000 | 2,84 | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S TB 0.00000% 08.05.23-31.07.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S 0.00000% 22.05.23-19.06.23** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK TB-REG-S 0.00000% 07.08.23-22.01.24** | CHF | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK BILL 0.00000% 12.02.24-11.03.24** | CHF | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONAL BANK TB 0.00000% 18.03.24-02.09.24** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 980 200 | 1,69 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Davon ausgeliehen | | |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal |
| SWISS NATIONALBANK BILLS-REG-S TB 0.00000% 15.05.23-12.06.23** | CHF | | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWISS NATIONALBANK BILLS TB 0.00000% 22.01.24-08.07.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 988 360 | 1,69 | |
| SWISS NATIONALBANK BILLS TB 0.00000% 26.02.24-21.05.24** | CHF | | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 991 200 | 2,26 | |
| SWISS NATIONALBANK BILLS TB 0.00000% 04.03.24-02.04.24** | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 2 000 000 | 1,13 | |
| SWISS NATIONALBANK BILLS TB 0.00000% 11.03.24-03.06.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 992 440 | 1,70 | |
| SWITZERLAND T-BILL-REG-S 0.00000% 10.11.22-11.05.23** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 12.01.23-13.04.23** | CHF | 700 000 | | 700 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 19.01.23-20.04.23** | CHF | 6 000 000 | | 6 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 26.01.23-27.04.23** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 02.02.23-04.05.23** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 06.04.23-06.07.23** | CHF | | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 27.07.23-26.10.23** | CHF | | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 05.10.23-04.01.24** | CHF | | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 26.10.23-25.01.24** | CHF | | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 02.11.23-01.02.24** | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 11.01.24-11.04.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 999 010 | 1,70 | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 25.01.24-25.04.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 997 270 | 1,70 | |
| SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 15.02.24-16.05.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 994 660 | 1,70 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 09.03.23-08.06.23** | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 20.04.23-20.07.23** | CHF | | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 27.04.23-27.07.23** | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 11.05.23-09.11.23** | CHF | | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 06.07.23-05.10.23** | CHF | | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 20.07.23-19.10.23** | CHF | | 4 500 000 | 4 500 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 03.08.23-02.11.23** | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 17.08.23-16.11.23** | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 31.08.23-30.11.23** | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 14.09.23-14.12.23** | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 19.10.23-18.01.24** | CHF | | 5 000 000 | 5 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 09.11.23-10.05.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 995 410 | 1,70 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 16.11.23-15.02.24** | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 23.11.23-22.02.24** | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 04.01.24-04.04.24** | CHF | | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 999 840 | 2,27 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 18.01.24-18.04.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 998 140 | 1,70 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 01.02.24-02.05.24** | CHF | | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 995 200 | 2,27 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 22.02.24-23.05.24** | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 4 989 812 | 2,83 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 07.03.24-06.06.24** | CHF | | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 989 200 | 2,26 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 14.03.24-13.06.24** | CHF | | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 988 000 | 2,26 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 21.03.24-20.06.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 990 100 | 1,70 | |
| SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 28.03.24-26.09.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 979 896 | 1,69 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 61 868 738 | 35,08 | |
| Total Treasury-Bills, Nullcoupon | | | | | | 61 868 738 | 35,08 | |

Inländische Depositenzertifikate, fester Zins

CHF

| | | | | | | | | |
|--|-----|--|-----------|--|-----------|--------------------|---------------|--|
| ZUERCHER KANTONALBANK CD 1.61000% 02.02.24-02.07.24** | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 3 000 674 | 1,70 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 3 000 674 | 1,70 | |
| Total Inländische Depositenzertifikate, fester Zins | | | | | | 3 000 674 | 1,70 | |
| Total Nicht-Effekten | | | | | | 113 743 868 | 64,50 | |
| Total Wertschriften | | | | | | 162 837 040 | 92,34 | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | 0,00 | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 9 992 135 | 5,67 | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | 3 036 422 | 1,72 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 480 833 | 0,27 | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 176 346 430 | 100,00 | |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | | -1 650 000 | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | | -7 608 | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | | 174 688 822 | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 49 093 172 | 27,84 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | 1 16 780 290 | 66,22 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 165 873 462 | 94,06 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

| Instrument | Nominal | Währung | Deckung in CHF | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|---|-------------|---------|-------------------|----------------------------------|-----------------------|
| Währungs-Swaps/Performance-Swaps | | | | | |
| UBS/DJ-UBS CMCH CHF EXCESS RET PAYER 0.62000% 11-31.12.49** | 171 748 191 | CHF | 174 784 613 | 3 036 422 | 1.72 |
| UBS/DJ-UBS CMCH CHF EXCESS RET SWAP REC 11-31.12.49 | 171 748 191 | CHF | | | |
| | | | 174 784 613 | 3 036 422 | 1.72 |

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

| Position | Betrag in CHF | in % des Nettofonds- vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Brutto Gesamtengagement aus Derivaten | 174 784 613,08 | 100,05 |
| Netto Gesamtengagement aus Derivaten | 52 346 389,63 | 29,97 |
| Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften | – | – |

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II

| | |
|-------------|-------|
| Klasse I-A1 | 0,63% |
| Klasse I-B | 0,06% |
| Klasse I-X | 0,01% |

Ausgabe- und Rücknahmepreis

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

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Bonds CHF Inland Government Passive II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|-------------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 689 342 829.89 | 361 798 777.77 | 494 450 146.86 |
| Klasse I-A1 | CH0048666470 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 863.02 | 809.82 | 864.63 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 14 347,1510 | 8 449,0660 | 7 714,0230 |
| Klasse I-A3 | CH0048666496 | ¹ | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 031.05 | | |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 310 256,3410 | | |
| Klasse I-X | CH0048666462 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 029.14 | 964.72 | 1 028.88 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 346 961,2630 | 367 937,0240 | 474 087,7450 |

¹ Erstemission per 24.1.2024

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-A1 | CHF | 7.1% | -5.8% | -8.8% |
| Klasse I-A3 ¹ | CHF | - | - | - |
| Klasse I-X | CHF | 7.2% | -5.7% | -8.6% |
| Benchmark: | | | | |
| SBI® Domestic Government (TR) | CHF | 7.4% | -5.7% | -8.6% |

¹ Auf Grund der Lancierung der Anteilklasse während des Geschäftsjahres liegen noch keine historischen Performancezahlen vor.

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------|--------------|
| Schweiz | 98,66 |
| TOTAL | 98,66 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 1 124 250.49 | 955 770.82 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 680 250 090.20 | 356 475 399.00 |
| Sonstige Vermögenswerte | 8 111 438.30 | 5 085 102.78 |
| Gesamtfondsvermögen | 689 485 778.99 | 362 516 272.60 |
| Aufgenommene Kredite | -105 459.86 | -716 384.18 |
| Andere Verbindlichkeiten | -37 489.24 | -1 110.65 |
| Nettofondsvermögen | 689 342 829.89 | 361 798 777.77 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 3 547.24 | 101.30 |
| Negativzinsen | -1 058.50 | -5 183.00 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 6 185 450.25 | 7 330 021.03 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 4 010 486.49 | 690 434.87 |
| TOTAL Ertrag | 10 198 425.48 | 8 015 374.20 |
| Aufwand | | |
| Prüfaufwand | -14 684.90 | -15 761.90 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1 | -12 540.89 | -11 683.00 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A3 | -68 707.27 | 0.00 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -10 186.09 | -12 607.03 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -253 585.53 | -2 356 519.32 |
| TOTAL Aufwand | -359 704.68 | -2 396 571.25 |
| Nettoertrag | 9 838 720.80 | 5 618 802.95 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -2 803 205.57 | -31 841 477.60 |
| Realisierter Erfolg | 7 035 515.23 | -26 222 674.65 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 30 390 361.95 | -8 355 742.66 |
| Gesamterfolg | 37 425 877.18 | -34 578 417.31 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|---------------------|---------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 9 838 720.80 | 5 618 802.95 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 9 838 720.80 | 5 618 802.95 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | -3 443 552.28 | -1 966 581.03 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -6 395 168.52 | -3 652 221.92 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 361 798 777.77 | 494 450 146.86 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -1 967 758.37 | -2 821 911.85 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | 292 085 933.31 | -95 251 039.93 |
| Gesamterfolg | 37 425 877.18 | -34 578 417.31 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 689 342 829.89 | 361 798 777.77 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| | Anzahl | Anzahl |
| Klasse I-A1 | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 8 449,0660 | 7 714,0230 |
| Ausgegebene Anteile | 5 898,0850 | 735,0430 |
| Zurückgenommene Anteile | 0,0000 | 0,0000 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 14 347,1510 | 8 449,0660 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 5 898,0850 | 735,0430 |
| Klasse I-A3 | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 0,0000 | |
| Ausgegebene Anteile | 315 591,6410 | |
| Zurückgenommene Anteile | -5 335,3000 | |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 310 256,3410 | |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 310 256,3410 | |
| Klasse I-X | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 367 937,0240 | 474 087,7450 |
| Ausgegebene Anteile | 0,0000 | 89 656,6030 |
| Zurückgenommene Anteile | -20 975,7610 | -195 807,3240 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 346 961,2630 | 367 937,0240 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -20 975,7610 | -106 150,7210 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Klasse I-A1

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 11.087 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -3.880 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 7.207 |

Klasse I-A3

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 14.616 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -5.116 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 9.500 |

Klasse I-X

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 14.827 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -5.189 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 9.638 |

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal | |
| Anleihen, fester Zins | | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | | |
| SWITZERLAND 3.50000%-REG-S 03-08.04.33* | CHF | 17 637 000 | 21 276 000 | 1 544 000 | 37 369 000 | 46 569 248 | 6,75 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30* | CHF | 16 994 000 | 13 483 000 | 1 109 000 | 29 368 000 | 29 024 394 | 4,21 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 16-30.05.58* | CHF | 10 615 000 | 10 624 000 | 451 000 | 20 788 000 | 19 998 056 | 2,90 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-24.05.55* | CHF | 9 285 000 | 13 752 000 | 1 076 000 | 21 961 000 | 20 862 950 | 3,03 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-28.06.45* | CHF | 16 663 000 | 16 787 000 | 1 560 000 | 31 890 000 | 30 515 541 | 4,43 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 18-27.06.32* | CHF | 15 107 000 | 13 301 000 | 1 486 000 | 26 922 000 | 26 534 323 | 3,85 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.25000% 21-23.06.35* | CHF | 9 070 000 | 9 198 000 | 739 000 | 17 529 000 | 16 705 137 | 2,42 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 24-24.05.55* | CHF | | 250 000 | 250 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 12-30.04.42* | CHF | 21 198 000 | 16 522 000 | 2 386 000 | 35 334 000 | 40 178 291 | 5,83 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 12-11.06.24* | CHF | 15 854 000 | | 15 854 000 | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 12-27.06.37* | CHF | 19 683 000 | 15 064 000 | 1 936 000 | 32 811 000 | 35 107 770 | 5,09 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 13-24.07.25* | CHF | 17 239 000 | 14 635 000 | 1 439 000 | 30 435 000 | 30 648 045 | 4,45 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 14-28.05.26* | CHF | 18 467 000 | 14 018 000 | 1 817 000 | 30 668 000 | 30 894 943 | 4,48 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 22-26.10.38* | CHF | 5 426 000 | 10 315 000 | | 15 741 000 | 17 472 510 | 2,53 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 23-28.06.43* | CHF | | 14 613 000 | | 14 613 000 | 16 218 969 | 2,35 | |
| SWITZERLAND-REG-S 2.50000% 06-08.03.36* | CHF | 19 528 000 | 19 546 000 | 1 576 000 | 37 498 000 | 45 485 074 | 6,60 | |
| SWITZERLAND-REG-S 2.25000% 11-22.06.31* | CHF | 16 403 000 | 13 052 000 | 1 614 000 | 27 841 000 | 30 889 590 | 4,48 | |
| SWITZERLAND-REG-S 2.00000% 14-25.06.64* | CHF | 16 547 000 | 13 379 000 | 1 877 000 | 28 049 000 | 42 353 990 | 6,14 | |
| SWITZERLAND-REG-S 3.25000% 07-27.06.27* | CHF | 14 467 000 | 11 778 000 | 1 316 000 | 24 929 000 | 26 821 111 | 3,89 | |
| SWITZERLAND-REG-S 4.00000% 98-08.04.28* | CHF | 27 248 000 | 21 450 000 | 2 680 000 | 46 018 000 | 51 848 481 | 7,52 | |
| SWITZERLAND-REG-S 4.00000% 99-06.01.49* | CHF | 13 549 000 | 10 368 000 | 1 332 000 | 22 585 000 | 39 751 859 | 5,77 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 597 880 281 | 86,71 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 597 880 281 | 86,71 | |
| Anleihen, Nullcoupon | | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 16-22.06.29* | CHF | 20 176 000 | 19 878 000 | 1 550 000 | 38 504 000 | 37 106 305 | 5,38 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-26.06.34* | CHF | 9 698 000 | 14 399 000 | 248 000 | 23 849 000 | 22 217 728 | 3,22 | |
| SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-24.07.39* | CHF | 12 295 000 | 13 870 000 | 638 000 | 25 527 000 | 23 045 776 | 3,34 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 82 369 809 | 11,95 | |
| Total Anleihen, Nullcoupon | | | | | | 82 369 809 | 11,95 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 680 250 090 | 98,66 | |
| Total Wertschriften | | | | | | 680 250 090 | 98,66 | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | (0,00) | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 1 124 250 | 0,16 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 8 111 439 | 1,18 | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 689 485 779 | 100,00 | |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | | -105 460 | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | | -37 489 | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | | 689 342 830 | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 680 250 090 | 98,66 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | – | – |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 680 250 090 | 98,66 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Bonds CHF Inland Government Passive II

Klasse I-A1

0,17%

Klasse I-X

0,01%

TER annualisiert:

Klasse I-A3

0,14%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|-------------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 697 634 027.00 | 730 570 936.32 | 492 814 802.64 |
| Klasse I-A1 | CH0244552409 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 860.06 | 835.09 | 941.25 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 5 496,9470 | 8 255,6640 | 16 902,0110 |
| Klasse I-B | CH0244558828 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 871.86 | 845.17 | 951.29 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 117 817,8210 | 190 058,6250 | 181 263,9680 |
| Klasse I-X | CH0244558836 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 875.03 | 847.95 | 954.11 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 674 471,3640 | 664 010,7840 | 319 113,1340 |

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|---|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-A1 | CHF | 4.8% | -9.6% | -8.5% |
| Klasse I-B | CHF | 5.0% | -9.3% | -8.3% |
| Klasse I-X | CHF | 5.1% | -9.3% | -8.3% |
| Benchmark: ¹ | | | | |
| 70% JESG EMBI Global Diversified (hedged CHF) / | | | | |
| 30% JESG CEMBI Broad Diversified (hedged CHF) | CHF | 5.0% | -9.1% | -8.7% |

¹ Benchmark bis 30.11.2021 30% JPM CEMBI Diversified hedged in CHF / 70% JPM EMBI Global Diversified, ab 1.12.2021 70% JESG EMBI Global Diversified (hedged CHF) / 30% JESG CEMBI Broad Diversified (hedged CHF).

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|------------------------------|--------------|
| Saudi-Arabien | 4,42 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 4,34 |
| Brasilien | 3,98 |
| Chile | 3,78 |
| Indonesien | 3,69 |
| Kolumbien | 3,67 |
| Mexiko | 3,60 |
| Türkei | 3,58 |
| Katar | 3,26 |
| Ungarn | 2,97 |
| Übrige | 59,54 |
| TOTAL | 96,83 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-----------------------|-------------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 30 293 347.07 | 733 655 254.38 |
| Geldmarktinstrumente | 0.00 | 2 740 300.18 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 682 999 327.40 | 700 913 674.16 |
| Derivative Finanzinstrumente | -17 733 310.32 | 16 757 089.82 |
| Sonstige Vermögenswerte | 9 756 410.15 | 9 683 791.12 |
| Gesamtfondsvermögen | 705 315 774.30 | 1 463 750 109.66 |
| Aufgenommene Kredite | -7 675 960.95 | -733 168 745.68 |
| Andere Verbindlichkeiten | -5 786.35 | -10 427.66 |
| Nettofondsvermögen | 697 634 027.00 | 730 570 936.32 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 237 375.02 | 23 599.35 |
| Negativzinsen | -10 479.33 | -3 587.17 |
| Erträge der Geldmarktinstrumente | 145 574.28 | 28 641.08 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 36 923 509.77 | 34 950 196.83 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 1 349 725.28 | 7 293 264.30 |
| TOTAL Ertrag | 38 645 705.02 | 42 292 114.39 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | -6 434.71 | -1 594.38 |
| Prüfaufwand | -16 300.40 | -14 684.90 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1 | -18 668.41 | -41 376.23 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | -76 222.95 | -93 560.80 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Aufwand Teilnahme an Sammelklagen | -128.59 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -3 068.90 | -424.77 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -3 458 185.99 | -4 044 573.80 |
| TOTAL Aufwand | -3 579 009.95 | -4 196 214.88 |
| Nettoertrag | 35 066 695.07 | 38 095 899.51 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -24 845 450.40 | -49 338 231.25 |
| Realisierter Erfolg | 10 221 244.67 | -11 242 331.74 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 22 254 397.18 | -41 737 847.68 |
| Gesamterfolg | 32 475 641.85 | -52 980 179.42 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 35 066 695.07 | 38 095 899.51 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 35 066 695.07 | 38 095 899.51 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer ¹ | -12 273 343.27 | -13 333 564.83 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -22 793 351.80 | -24 762 334.68 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 730 570 936.32 | 492 814 802.64 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -13 451 787.40 | -11 430 749.46 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | -51 960 763.77 | 302 167 062.56 |
| Gesamterfolg | 32 475 641.85 | -52 980 179.42 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 697 634 027.00 | 730 570 936.32 |

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizilierte Anleger gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs.1 VStV

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Klasse I-A1 | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 8 255,6640 | 16 902,0110 |
| Ausgegebene Anteile | 331,0490 | 1 883,0450 |
| Zurückgenommene Anteile | -3 089,7660 | -10 529,3920 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 5 496,9470 | 8 255,6640 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -2 758,7170 | -8 646,3470 |
| Klasse I-B | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 190 058,6250 | 181 263,9680 |
| Ausgegebene Anteile | 0,0000 | 22 922,4810 |
| Zurückgenommene Anteile | -72 240,8040 | -14 127,8240 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 117 817,8210 | 190 058,6250 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -72 240,8040 | 8 794,6570 |
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 664 010,7840 | 319 113,1340 |
| Ausgegebene Anteile | 72 494,7050 | 432 615,8210 |
| Zurückgenommene Anteile | -62 034,1250 | -87 718,1710 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 674 471,3640 | 664 010,7840 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 10 460,5800 | 344 897,6500 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

| | | |
|---|------------|---------------|
| Klasse I-A1 | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 40.883 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹ | CHF | -14.309 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 26.574 |
| Klasse I-B | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 43.456 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹ | CHF | -15.210 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 28.246 |
| Klasse I-X | | |
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 44.067 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹ | CHF | -15.423 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 28.644 |

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizilierte Anleger gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs.1 VStV

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal | |
| MAGYAR EXPORT-IMPORT BANK ZRT-REG-S 6.12500% 23-04.12.27* | | 2 300 000 | 1 000 000 | 1 300 000 | 1 178 228 | 0,17 | | |
| MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK BHD-REG-S 3.04300% 15-22.04.25* | 1 465 000 | | 300 000 | 1 165 000 | 1 026 690 | 0,15 | | |
| MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK BHD-REG-S 4.23600% 15-22.04.45* | 975 000 | 200 000 | 840 000 | 335 000 | 279 104 | 0,04 | | |
| MANILA WATER CO INC-REG-S 4.37500% 20-30.07.30* | 880 000 | | 340 000 | 540 000 | 455 503 | 0,06 | | |
| MC BRAZIL DOWNSTREAM TRADING SARL-REG-S 7.25000% 21-30.06.31* | 200 000 | | | 200 000 | 154 398 | 0,02 | | |
| MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.50000% 22-28.04.33* | 400 000 | | | 400 000 | 372 634 | 0,05 | | |
| MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27* | 200 000 | | | 200 000 | 175 550 | 0,02 | | |
| MEDCO LAUREL TREE PTE LTD-REG-S 6.95000% 21-12.11.28* | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| MEDCO OAK TREE PTE LTD-REG-S 7.37500% 19-14.05.26* | 510 000 | 285 000 | | 795 000 | 716 257 | 0,10 | | |
| MEGAWORLD CORP-REG-S 4.12500% 20-30.07.27* | 200 000 | | | 200 000 | 170 212 | 0,02 | | |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 4.87500% 17-06.06.25* | 250 000 | | | 250 000 | 219 756 | 0,03 | | |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.62500% 19-17.07.27* | 600 000 | | | 600 000 | 516 904 | 0,07 | | |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 19-04.12.29* | 500 000 | | | 500 000 | 410 787 | 0,06 | | |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28* | 640 000 | | | 640 000 | 545 832 | 0,08 | | |
| MERCADOLIBRE INC 2.37500% 21-14.01.26* | 200 000 | | | 200 000 | 168 825 | 0,02 | | |
| MERCADOLIBRE INC 3.12500% 21-14.01.31* | 200 000 | | | 200 000 | 150 980 | 0,02 | | |
| METINVEST BV-REG-S 7.65000% 20-01.10.27* | | 400 000 | | 400 000 | 257 600 | 0,04 | | |
| MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46* | 470 000 | 200 000 | | 670 000 | 486 924 | 0,07 | | |
| MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 4.00000% 17-04.10.27* | 200 000 | | | 200 000 | 170 597 | 0,02 | | |
| MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48* | | 200 000 | | 200 000 | 155 314 | 0,02 | | |
| MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26* | 200 000 | 240 000 | 200 000 | 240 000 | 208 771 | 0,03 | | |
| MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.65900% 20-24.05.31* | 500 000 | 590 000 | | 1 090 000 | 818 790 | 0,12 | | |
| MEXICO REMITTANCES F F E M S-REG-S 4.87500% 21-15.01.28* | 200 000 | | | 200 000 | 128 890 | 0,02 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40* | 300 000 | 190 000 | 120 000 | 370 000 | 330 031 | 0,05 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.2110* | 560 000 | 410 000 | 910 000 | 60 000 | 47 321 | 0,01 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47* | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.15000% 17-28.03.27* | 1 000 000 | 200 000 | 400 000 | 800 000 | 702 321 | 0,10 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48* | 860 000 | 200 000 | 330 000 | 730 000 | 528 064 | 0,07 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 18-11.01.28* | 1 000 000 | 400 000 | 200 000 | 1 200 000 | 1 027 811 | 0,15 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29* | 800 000 | | | 800 000 | 697 142 | 0,10 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-31.01.50* | 1 020 000 | 200 000 | 984 000 | 236 000 | 167 608 | 0,02 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.25000% 20-16.04.30* | 489 000 | | | 489 000 | 392 214 | 0,06 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 20-27.04.32* | 430 000 | | | 430 000 | 367 452 | 0,05 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 5.00000% 20-27.04.51* | 500 000 | 300 000 | | 800 000 | 607 072 | 0,09 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.77100% 20-24.05.61* | 320 000 | 700 000 | | 1 020 000 | 598 312 | 0,08 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.28000% 21-14.08.41* | 2 600 000 | | 740 000 | 1 860 000 | 1 346 943 | 0,19 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.50000% 22-12.02.34* | 1 576 000 | 800 000 | 1 030 000 | 1 346 000 | 1 010 790 | 0,14 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.40000% 22-12.02.52* | 400 000 | 230 000 | | 630 000 | 434 624 | 0,06 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.87500% 22-19.05.33* | | 200 000 | | 200 000 | 170 795 | 0,02 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 6.33800% 23-04.05.53* | | 230 000 | | 230 000 | 204 895 | 0,03 | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 6.00000% 24-07.05.36* | | 900 000 | | 900 000 | 812 251 | 0,12 | | |
| MFB MAGYAR FEJLESZTESI BANK-REG-S 6.50000% 23-29.06.28* | | 1 250 000 | 200 000 | 1 050 000 | 961 103 | 0,14 | | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 19-15.05.26* | 710 000 | | 200 000 | 510 000 | 453 677 | 0,06 | | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.25000% 20-18.06.25* | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 4.75000% 21-01.02.27* | | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| MGM CHINA HOLDINGS-REG-S 5.37500% 19-15.05.24* | 270 000 | | | 270 000 | 242 465 | 0,03 | | |
| MHP LUX SA-REG-S 6.25000% 19-19.09.29* | | 400 000 | | 400 000 | 255 197 | 0,04 | | |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28* | 200 000 | 400 000 | | 600 000 | 462 515 | 0,07 | | |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.25000% 19-25.03.29* | 400 000 | 200 000 | | 600 000 | 474 219 | 0,07 | | |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 4.50000% 20-27.04.31* | 530 000 | 390 000 | 400 000 | 520 000 | 398 109 | 0,06 | | |
| MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 4.37500% 21-18.03.31* | | 200 000 | | 200 000 | 149 741 | 0,02 | | |
| MINSUR SA-REG-S 4.50000% 21-28.10.31* | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 157 960 | 0,02 | | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.65000% 23-19.01.28* | 728 000 | 400 000 | 200 000 | 933 000 | 884 665 | 0,13 | | |
| MONTENEGRO, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 24-12.03.31* | | 800 000 | | 800 000 | 732 168 | 0,10 | | |
| MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.00000% 20-15.12.50* | 1 204 000 | | | 1 204 000 | 741 488 | 0,11 | | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 2.37500% 20-15.12.27* | 800 000 | 210 000 | | 1 010 000 | 810 776 | 0,11 | | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 3.00000% 20-15.12.32* | 1 105 000 | 500 000 | 410 000 | 1 195 000 | 865 105 | 0,12 | | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 5.95000% 23-08.03.28* | | 1 050 000 | 200 000 | 850 000 | 774 208 | 0,11 | | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 6.50000% 23-08.09.33* | | 1 310 000 | 220 000 | 1 090 000 | 1 013 749 | 0,14 | | |
| MOVIDA EUROPE SA-REG-S 5.25000% 21-08.02.31* | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26* | 645 000 | | 400 000 | 245 000 | 222 395 | 0,03 | | |
| MULTIBANK INC-REG-S 7.75000% 23-03.02.28* | | 200 000 | | 200 000 | 181 604 | 0,03 | | |
| MVM ENERGETIKA ZRT-REG-S 7.50000% 23-09.06.28* | | 1 400 000 | 200 000 | 1 200 000 | 1 123 736 | 0,16 | | |
| NAGACORP LTD-REG-S 7.95000% 20-06.07.24* | 400 000 | | 400 000 | | | | | |
| NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 7.62500% 19-08.11.28* | 400 000 | | | 400 000 | 217 969 | 0,03 | | |
| NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 15-29.10.25* | 1 180 000 | | 430 000 | 750 000 | 668 500 | 0,09 | | |
| NATIONAL CENTRAL COOLING CO-REG-S 2.50000% 20-21.10.27* | 210 000 | | | 210 000 | 170 416 | 0,02 | | |
| NATURA & CO LUXEMBOURG HOLDINGS-REG-S 6.00000% 22-19.04.29* | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| NAVER CORP-REG-S 1.50000% 21-29.03.26* | 450 000 | | | 450 000 | 375 395 | 0,05 | | |
| NBM US HOLDINGS INC-REG-S 6.62500% 19-06.08.29* | 200 000 | | | 200 000 | 179 014 | 0,03 | | |
| NEMAK SAB DE CV-REG-S 3.62500% 21-28.06.31* | 200 000 | | | 200 000 | 145 238 | 0,02 | | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--|--------------------|-----------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 7.37500% 05-05.02.25* | USD | 580 000 | | | 580 000 | 530 524 | 0,08 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36* | USD | 440 000 | 300 000 | 290 000 | 450 000 | 381 503 | 0,05 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 7.25000% 08-05.03.38* | USD | 152 000 | | 100 000 | 52 000 | 45 168 | 0,01 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.75000% 10-30.05.40* | USD | 246 000 | 160 000 | 290 000 | 116 000 | 93 119 | 0,01 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41* | USD | 1 155 000 | 380 000 | 200 000 | 1 335 000 | 990 881 | 0,14 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43* | USD | 980 000 | 488 000 | 800 000 | 668 000 | 422 671 | 0,06 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 349 472 | 0,05 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27* | USD | 280 000 | 430 000 | | 710 000 | 631 703 | 0,09 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47* | USD | 535 000 | 630 000 | 240 000 | 925 000 | 634 494 | 0,09 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.12500% 18-17.02.28* | USD | 1 970 000 | | 400 000 | 1 570 000 | 1 343 394 | 0,19 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 7.62500% 19-26.04.29* | USD | 650 000 | | | 650 000 | 597 530 | 0,08 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.35000% 19-10.08.24* | USD | 460 000 | | 460 000 | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.60000% 19-14.11.24* | USD | 1 550 000 | | 1 550 000 | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 20-13.03.25* | USD | 655 000 | | | 655 000 | 581 847 | 0,08 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.25000% 20-13.03.30* | USD | 720 000 | 2 030 000 | 700 000 | 2 050 000 | 1 670 447 | 0,24 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.95000% 20-15.01.31* | USD | 555 000 | | | 555 000 | 462 397 | 0,07 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.50000% 21-20.09.33* | USD | 280 000 | | | 280 000 | 236 434 | 0,03 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 9.87500% 22-15.01.28* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 248 044 | 0,04 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 9.12500% 23-13.07.30* | USD | | 860 000 | | 860 000 | 840 443 | 0,12 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 8.60000% 22-24.09.27* | USD | 280 000 | | | 280 000 | 267 643 | 0,04 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 22-24.02.27* | USD | 1 460 000 | | 500 000 | 960 000 | 881 425 | 0,12 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-19.01.33* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 501 014 | 0,07 | |
| TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS-REG-S 9.37500% 23-31.01.26* | USD | 210 000 | | | 210 000 | 198 013 | 0,03 | |
| TURKIYE IS BANKASI-REG-S 6.12500% 17-25.04.24* | USD | 800 000 | | 800 000 | | | | |
| TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 6.00000% 20-23.01.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 270 345 | 0,04 | |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.25000% 20-05.02.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 789 | 0,03 | |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 6.50000% 20-08.01.26* | USD | 420 000 | | | 420 000 | 376 521 | 0,05 | |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.50000% 21-01.10.26* | USD | 460 000 | | | 460 000 | 400 727 | 0,06 | |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 9.00000% 23-12.10.28* | USD | | 870 000 | 530 000 | 340 000 | 321 519 | 0,05 | |
| UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 4.91700% 23-25.09.33* | USD | | 350 000 | | 350 000 | 323 422 | 0,05 | |
| UKRAINE RAILWAYS VIA RL CPTL MKTS-REG-S 8.25000% 19-09.07.24* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 212 565 | 0,03 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-144A 7.75000% 15-01.09.25* | USD | 260 000 | | 260 000 | | | | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-144A 7.75000% 15-01.09.27* | USD | 1 791 000 | | | 1 791 000 | 546 859 | 0,08 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-144A 7.75000% 15-01.09.28* | USD | 433 000 | 200 000 | | 633 000 | 189 288 | 0,03 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 15-01.09.25* | USD | 985 000 | | | 985 000 | 330 478 | 0,05 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 15-01.09.26* | USD | 930 000 | | | 930 000 | 299 460 | 0,04 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 15-01.09.27* | USD | 946 000 | 250 000 | | 1 196 000 | 365 183 | 0,05 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.28* | USD | 568 000 | 250 000 | | 818 000 | 244 609 | 0,03 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.29* | USD | 997 000 | | 997 000 | | | | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 17-25.09.34* | USD | 2 088 000 | | 300 000 | 1 788 000 | 469 447 | 0,07 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 18-01.02.26* | USD | 350 000 | 250 000 | | 600 000 | 204 009 | 0,03 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.30* | USD | 3 325 000 | | 504 000 | 2 821 000 | 886 765 | 0,13 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.87600% 21-21.05.31* | USD | 1 770 000 | | 400 000 | 1 370 000 | 359 699 | 0,05 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 20-15.03.35* | USD | 2 640 000 | | | 2 640 000 | 690 765 | 0,10 | |
| ULKER BISKUVI SANAYI-REG-S 6.95000% 20-30.10.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 519 | 0,03 | |
| ULTRAPAR INTERNATIONAL SA-REG-S 5.25000% 19-06.06.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 145 | 0,02 | |
| UNIGEL LUXEMBOURG SA-REG-S *DEFAULTED* 8.75000% 19-01.10.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45* | USD | 890 000 | 550 000 | 670 000 | 770 000 | 612 915 | 0,09 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 15-27.10.27* | USD | 2 995 000 | | 1 195 000 | 1 800 000 | 1 607 074 | 0,23 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 5.75000% 22-28.10.34* | USD | 370 000 | 500 000 | 210 000 | 660 000 | 627 529 | 0,09 | |
| USIMINAS INTERNATIONAL SARL-REG-S 5.87500% 19-18.07.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 550 | 0,03 | |
| UZAUTO MOTORS AJ-REG-S 4.85000% 21-04.05.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 166 518 | 0,02 | |
| UZBEKNEFTEGAZ JSC-REG-S 4.75000% 21-16.11.28* | USD | 530 000 | 450 000 | 200 000 | 780 000 | 589 204 | 0,08 | |
| VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 6.80000% 10-22.11.25* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 0 | 0,00 | |
| VENEZUELA, REP OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19* | USD | 42 000 | | 42 000 | | | | |
| VIVO ENERGY INVEST BV-REG-S 5.12500% 20-24.09.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 342 940 | 0,05 | |
| VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27* | USD | 345 000 | | | 345 000 | 303 070 | 0,04 | |
| VOLCAN CIA MINERA SAA-REG-S 4.37500% 21-11.02.26* | USD | | 140 000 | | 140 000 | 77 826 | 0,01 | |
| VTR COMUNICACION SPA-REG-S 5.12500% 20-15.01.28* | USD | 328 000 | | | 328 000 | 208 278 | 0,03 | |
| VTR FINANCE NV-REG-S 6.37500% 20-15.07.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| WIPRO IT SERVICES LLC-REG-S 1.50000% 21-23.06.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 165 844 | 0,02 | |
| WOORI BANK-REG-S 2.00000% 22-20.01.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 165 631 | 0,02 | |
| WYNN MACAU LTD-REG-S 4.87500% 17-01.10.24* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 027 | 0,03 | |
| WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 17-01.10.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 172 443 | 0,02 | |
| WYNN MACAU LTD-REG-S 5.12500% 19-15.12.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 164 504 | 0,02 | |
| WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 351 177 | 0,05 | |
| WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 512 224 | 0,07 | |
| XP INC-REG-S 3.25000% 21-01.07.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 168 318 | 0,02 | |
| YANLORD LAND HK CO LTD-REG-S 5.12500% 21-20.05.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 214 817 | 0,03 | |
| YPF ENERGIA ELECTRICA SA-REG-S 10.00000% 19-25.07.26* | USD | 165 000 | | | 165 000 | 146 293 | 0,02 | |
| YPF SA-REG-S 6.95000% 17-21.07.27* | USD | 440 000 | | 230 000 | 210 000 | 169 768 | 0,02 | |
| YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47* | USD | 458 000 | | 170 000 | 288 000 | 190 822 | 0,03 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Davon ausgeliehen | | | |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|------|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal | |
| SWIRE PACIFIC MTN FINANCING LTD-REG-S 4.50000% 13-09.10.23* | USD | 250 000 | | | 250 000 | | | |
| SWIRE PACIFIC MTN FINANCING LTD-REG-S 3.87500% 15-21.09.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | | | |
| SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING-REG-S 3.62500% 16-13.01.26* | USD | 260 000 | | | 260 000 | 227 148 | 0,03 | |
| TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-29.09.23* | USD | 230 000 | | | | | | |
| TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 9.50000% 23-01.08.26* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 190 160 | 0,03 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.29000% 20-03.06.60* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 230 558 | 0,03 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 2.88000% 21-22.04.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 156 763 | 0,02 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.68000% 21-22.04.41* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 142 595 | 0,02 | |
| THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.87500% 18-23.01.43* | USD | 360 000 | | | | | | |
| THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.37500% 18-20.11.48* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 330 539 | 0,05 | |
| THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.50000% 19-17.10.49* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 244 947 | 0,03 | |
| THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.50000% 20-18.06.30* | USD | 855 000 | | 300 000 | 555 000 | 420 701 | 0,06 | |
| THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50* | USD | 305 000 | | | 305 000 | 194 640 | 0,03 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 11.87500% 00-15.01.30* | USD | 230 000 | | | 230 000 | 258 239 | 0,04 | |
| TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 5.87500% 21-14.01.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 550 | 0,03 | |
| TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 9.37500% 23-19.10.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 192 862 | 0,03 | |
| UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 2.00000% 21-19.10.31* | USD | 255 000 | | | | | | |
| UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 3.25000% 21-19.10.61* | USD | 1 280 000 | | 236 000 | 1 044 000 | 648 241 | 0,09 | |
| UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 2.87500% 21-19.10.41* | USD | 735 000 | | | 735 000 | 486 994 | 0,07 | |
| UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.05000% 22-07.07.32* | USD | 550 000 | | 310 000 | 240 000 | 207 994 | 0,03 | |
| UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.95100% 22-07.07.52* | USD | 350 000 | 200 000 | | 550 000 | 473 247 | 0,07 | |
| UNITY 1 SUKUK LTD-REG-S 2.39400% 20-03.11.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 171 642 | 0,02 | |
| VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 4.15000% 18-18.04.23* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.15000% 19-12.05.25* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 130 602 | 0,02 | |
| VENA ENERGY CAPITAL PTE LTD-REG-S 3.13300% 20-26.02.25* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 219 157 | 0,03 | |
| VIGOROUS CHAMPION INTERNATIONAL-REG-S 4.25000% 19-28.05.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 696 | 0,02 | |
| WHARF REIC FIN-REG-S 2.87500% 20-07.05.30* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 158 776 | 0,02 | |
| WHEELOCK MTN BVI LTD-REG-S 2.37500% 21-25.01.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 925 | 0,02 | |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.85000% 17-21.06.24* | USD | 700 000 | | 700 000 | | | | |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 8.25000% 19-15.10.24* | USD | 460 000 | | | 460 000 | 418 465 | 0,06 | |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 9.25000% 23-16.10.28* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 382 392 | 0,05 | |
| TOTAL USD | | | | | 103 594 867 | 14,69 | | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | 103 594 867 | 14,69 | | |
| Medium-Term Notes, variabler Zins | | | | | | | | |
| USD | | | | | | | | |
| AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 2.700%/VAR 21-PRP* | USD | 450 000 | 200 000 | 380 000 | 270 000 | 226 887 | 0,03 | |
| AXIS BANK LTD/GIFT CITY-REG-S-SUB COCO 4.100%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 451 | 0,02 | |
| BANKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.733%/VAR 19-25.09.34* | USD | 700 000 | 1 180 000 | 700 000 | 1 180 000 | 945 267 | 0,13 | |
| BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 5.825%/VAR 20-PRP* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 217 857 | 0,03 | |
| BOC AVIATION LTD-REG-S 3M LIBOR+130BP 18-21.05.25* | USD | 1 110 000 | | 710 000 | 400 000 | 361 787 | 0,05 | |
| CHINA CITIC BK INTERNATIONAL LTD-REG-S-SUB 7.100%/VAR 18-PRP* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| CHINA RESOURCES LAND LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 537 | 0,03 | |
| CHONG HING BANK LTD-REG-S-SUB 5.700%/VAR 19-PRP* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 223 542 | 0,03 | |
| CIMB BANK BHD-REG-S 3M LIBOR+78BP 19-09.10.24* | USD | 275 000 | | 275 000 | | | | |
| DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-02.11.31* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 207 312 | 0,03 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.300%/VAR 20-PRP* | USD | 440 000 | | | 440 000 | 385 390 | 0,05 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 1.822%/VAR 21-10.03.31* | USD | 550 000 | | 290 000 | 260 000 | 217 820 | 0,03 | |
| ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 3M LIBOR+105BP 19-20.11.24* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 180 803 | 0,03 | |
| KASIKORNBANK PCL-REG-S-SUB 5.275%/VAR 20-PRP* | USD | 240 000 | | | 240 000 | 211 304 | 0,03 | |
| KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.343%/VAR 19-02.10.31* | USD | 400 000 | 200 000 | | 600 000 | 502 596 | 0,07 | |
| KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB COCO 4.000%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 166 163 | 0,02 | |
| KEB HANA BANK-REG-S 3M LIBOR+75BP 19-13.06.24* | USD | 390 000 | | 390 000 | | | | |
| KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.350%/VAR 19-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 699 | 0,03 | |
| MALAYAN BANKING BHD-REG-S 3M LIBOR+80BP 19-16.08.24* | USD | 455 000 | | 455 000 | | | | |
| OTP BANK NYRT-REG-S 7.500%/VAR 23-25.05.27* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 416 461 | 0,06 | |
| OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 8.750%/VAR 23-15.05.33* | USD | | 624 000 | | 420 000 | 204 000 | 190 270 | 0,03 |
| SHINHAN BANK-REG-S 3M LIBOR+170BP 20-24.04.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 352 066 | 0,05 | |
| STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 3.516%/VAR 19-12.02.30* | USD | | 395 000 | | 395 000 | 345 450 | 0,05 | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 982 | 0,03 | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31* | USD | 1 260 000 | | | 1 260 000 | 1 038 955 | 0,15 | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.863%/VAR 22-07.10.32* | USD | 300 000 | 450 000 | | 750 000 | 641 271 | 0,09 | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP* | USD | 585 000 | | 585 000 | | | | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-16.03.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 167 114 | 0,02 | |
| WOORI BANK-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 726 | 0,03 | |
| TOTAL USD | | | | | 7 878 710 | 1,12 | | |
| Total Medium-Term Notes, variabler Zins | | | | | 7 878 710 | 1,12 | | |

| Titel | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon |
|---|---------------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | Käufe ¹ | Verkäufe ² | | | Anzahl/ Nominal |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37* | USD | 115 000 | | 115 000 | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.62500% 13-15.04.43* | USD | 360 000 | 690 000 | | 1 050 000 | 880 839 0,12 |
| INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES-REG-S 4.37500% 19-12.09.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 1.04000% 20-22.06.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 170 987 0,02 |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 15-03.03.28* | USD | 460 000 | 200 000 | 200 000 | 460 000 | 408 884 0,06 |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33* | USD | 965 000 | 200 000 | 200 000 | 965 000 | 781 171 0,11 |
| JAMAICA, GOVERNMENT OF 8.00000% 07-15.03.39* | USD | 1 675 000 | 300 000 | 700 000 | 1 275 000 | 1 362 998 0,19 |
| JAPFA COMFEED INDONESIA TBK PT-REG-S 5.37500% 21-23.03.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 165 729 0,02 |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 17-10.10.47* | USD | 745 000 | 330 000 | 200 000 | 875 000 | 695 756 0,10 |
| KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 3.87500% 14-14.10.24* | USD | 265 000 | | | 265 000 | 237 623 0,03 |
| KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 14-14.10.44* | USD | 1 540 000 | 891 000 | 1 700 000 | 731 000 | 627 414 0,09 |
| KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 2.50000% 20-04.11.30* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 447 516 0,06 |
| KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29* | USD | 200 000 | 220 000 | 200 000 | 220 000 | 179 216 0,03 |
| KSA SUKUK LTD-REG-S 4.51100% 23-22.05.33* | USD | | 710 000 | | 710 000 | 624 309 0,09 |
| LATAM AIRLINES GROUP SA-REG-S 13.37500% 22-15.10.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 207 555 0,03 |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 12-29.11.27* | USD | | 1 200 000 | 500 000 | 700 000 | 41 297 0,01 |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.05000% 15-02.11.35* | USD | | 1 200 000 | 470 000 | 730 000 | 43 067 0,01 |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-23.03.37* | USD | | 1 540 000 | | 1 540 000 | 90 854 0,01 |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-23.03.32* | USD | | 1 200 000 | 460 000 | 740 000 | 43 657 0,01 |
| LG CHEM LTD-REG-S 3.25000% 19-15.10.24* | USD | 260 000 | | | 260 000 | 231 107 0,03 |
| LG CHEM LTD-REG-S 3.62500% 19-15.04.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 460 0,02 |
| LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD-REG-S 5.87500% 15-05.07.34* | USD | 785 000 | | 450 000 | 335 000 | 130 755 0,02 |
| LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD-REG-S 4.35000% 19-05.04.36* | USD | 200 000 | 400 000 | | 600 000 | 429 154 0,06 |
| LIMAK ISKENDERUN ULUSLARARASI-REG-S 9.50000% 21-10.07.36* | USD | 200 000 | | 200 000 | | |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 94 574 0,01 |
| MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S 4.75000% 14-07.05.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | |
| MAF SUKUK LTD-REG-S 4.63800% 19-14.05.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 175 637 0,02 |
| MALAYSIA SUKUK GLOBAL BHD-REG-S 3.17900% 16-27.04.26* | USD | 725 000 | | | 725 000 | 631 791 0,09 |
| MALAYSIA SUKUK GLOBAL BHD-REG-S 4.08000% 16-27.04.46* | USD | 750 000 | | | 750 000 | 605 378 0,09 |
| MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 2.07000% 21-28.04.31* | USD | 750 000 | 1 015 000 | 800 000 | 965 000 | 740 833 0,11 |
| MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 3.07500% 21-28.04.51* | USD | 260 000 | | | 260 000 | 172 976 0,02 |
| MAR SUKUK LTD-REG-S 3.02500% 19-13.11.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | |
| MAR SUKUK LTD-REG-S 2.21000% 20-02.09.25* | USD | 500 000 | | | 500 000 | |
| MASHREQBANK PSC-REG-S 4.25000% 19-26.02.24* | USD | 200 000 | 200 000 | 400 000 | | |
| MAZOOON ASSETS CO SAOC-REG-S 5.20000% 17-08.11.27* | USD | 520 000 | | | 520 000 | 462 949 0,07 |
| MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.08400% 23-22.05.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 169 887 0,02 |
| MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.25000% 19-26.04.26* | USD | 600 000 | 200 000 | | 800 000 | 695 762 0,10 |
| METINVEST BV-REG-S 7.75000% 19-17.10.29* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 251 684 0,04 |
| MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 152 162 0,02 |
| MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | |
| MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 152 049 0,02 |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 20-07.04.26* | USD | 735 000 | | 200 000 | 535 000 | 467 813 0,07 |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31* | USD | 800 000 | | 250 000 | 550 000 | 419 700 0,06 |
| MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42* | USD | 660 000 | 500 000 | 600 000 | 560 000 | 443 707 0,06 |
| MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO-REG-S 5.62500% 19-27.02.24* | USD | 510 000 | | | 510 000 | |
| MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO-REG-S 4.10000% 20-21.01.27* | USD | 275 000 | 200 000 | | 475 000 | 405 505 0,06 |
| NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33* | USD | 200 000 | 240 000 | | 440 000 | 343 099 0,05 |
| NOGAHOLDING SUKUK LTD-REG-S 5.25000% 21-08.04.29* | USD | | 810 000 | | 810 000 | 706 540 0,10 |
| OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 172 727 0,02 |
| OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29* | USD | | 200 000 | 200 000 | | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 20-28.10.27* | USD | 800 000 | 410 000 | | 1 210 000 | 1 133 781 0,16 |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.37500% 20-28.10.32* | USD | 2 064 000 | 400 000 | 1 020 000 | 1 444 000 | 1 445 304 0,20 |
| OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28* | USD | 410 000 | | | 410 000 | 379 789 0,05 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27* | USD | 2 000 | | | 2 000 | 1 944 0,00 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26* | USD | 160 000 | 100 000 | | 260 000 | 237 548 0,03 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36* | USD | 1 569 000 | | | 1 569 000 | 1 367 976 0,19 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53* | USD | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 200 000 | 116 247 0,02 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25* | USD | 2 210 000 | | 1 328 000 | 882 000 | 772 571 0,11 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.87500% 16-17.03.28* | USD | 2 435 000 | | | 2 435 000 | 1 998 558 0,28 |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50* | USD | 2 880 000 | | 520 000 | 2 360 000 | 1 428 172 0,20 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26* | USD | 400 000 | | 322 000 | 78 000 | 69 227 0,01 |
| PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 5.37500% 15-05.05.45* | USD | 200 000 | | 200 000 | | |
| PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 4.25000% 15-05.05.25* | USD | 220 000 | 230 000 | 220 000 | 230 000 | 203 950 0,03 |
| PERU PENER SBSN INDO III-REG-S 2.30000% 20-23.06.25* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 304 612 0,04 |
| PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26* | USD | 1 108 000 | 200 000 | 312 000 | 996 000 | 850 000 0,12 |
| PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31* | USD | 800 000 | | 400 000 | 400 000 | 309 503 0,04 |
| PERU, REPUBLIC OF 4.12500% 15-25.08.27* | USD | 1 236 000 | | 120 000 | 1 116 000 | 974 083 0,14 |
| PERU, REPUBLIC OF 6.55000% 07-14.03.37* | USD | 1 410 000 | | 60 000 | 1 350 000 | 1 321 200 0,19 |
| PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25* | USD | 750 000 | | 750 000 | | |
| PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33* | USD | 647 000 | | | 647 000 | 719 882 0,10 |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA PT-REG-S 5.12500% 14-16.05.24* | USD | 263 000 | | 263 000 | | |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.15000% 17-29.03.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 175 637 0,02 |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 2.80000% 20-23.06.30* | USD | 880 000 | | | 880 000 | 701 782 0,10 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| TML HOLDINGS PTE LTD-REG-S 4.35000% 21-09.06.26* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 172 034 | 0,02 |
| TMS ISSUER SARL-REG-S 5.78000% 23-23.08.32* | USD | 200 000 | | 200 000 | 400 000 | 370 525 | 0,05 |
| TRUST FIBRA UNO-REG-S 7.37500% 24-13.02.34* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 269 534 | 0,04 |
| TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 349 359 | 0,05 |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 14-22.03.24* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.62500% 14-17.02.45* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 464 637 | 0,07 |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26* | USD | 315 000 | | | 315 000 | 273 436 | 0,04 |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28* | USD | 390 000 | 230 000 | | 620 000 | 546 044 | 0,08 |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.37500% 20-14.10.25* | USD | 260 000 | | | 260 000 | 235 353 | 0,03 |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.87500% 21-26.06.31* | USD | 200 000 | 400 000 | | 600 000 | 496 004 | 0,07 |
| TURKEY, REPUBLIC OF-REG-S 4.48900% 14-25.11.24* | USD | 880 000 | | 200 000 | 680 000 | 608 074 | 0,09 |
| TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS-REG-S 5.75000% 21-06.07.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 175 718 | 0,02 |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 8.12500% 19-28.03.24* | USD | 390 000 | | 390 000 | | | |
| UPL CORP LTD-REG-S 4.62500% 20-16.06.30* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 142 311 | 0,02 |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36* | USD | 2 369 000 | 400 000 | | 2 769 000 | 3 015 448 | 0,43 |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50* | USD | 4 157 000 | 1 683 000 | 1 150 000 | 4 690 000 | 4 085 674 | 0,58 |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55* | USD | 4 370 000 | 1 130 000 | 2 102 000 | 3 398 000 | 2 872 162 | 0,41 |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 19-23.01.31* | USD | 2 075 000 | 110 000 | | 2 185 000 | 1 926 824 | 0,27 |
| VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 05-09.12.20* | USD | 325 000 | | 325 000 | | | |
| VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 07-31.03.38* | USD | 170 000 | | 170 000 | | | |
| VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24* | USD | 1 025 000 | | 200 000 | 825 000 | 737 133 | 0,10 |
| WE SODA INVESTMENTS HOLDING PLC-REG-S 9.50000% 23-06.10.28* | USD | | 600 000 | | 600 000 | 560 621 | 0,08 |
| WE SODA INVESTMENTS HOLDING PLC-REG-S 9.37500% 24-14.02.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 184 845 | 0,03 |
| WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 12-20.09.22* | USD | 245 000 | 200 000 | | 445 000 | 261 746 | 0,04 |
| ZIRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA AS-REG-S 9.37500% 23-12.11.26* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 190 329 | 0,03 |
| TOTAL USD | | | | | | 131 094 340 | 18,59 |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 131 094 340 | 18,59 |

Anleihen, variabler Zins

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|---------|---------|---------|------|
| ABSA GROUP LIMITED-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-25.04.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| ADIB CAPITAL INVEST 2 LTD-REG-S-SUB 7.125%/VAR 18-PRP* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| AKBANK TAS-144A-SUB 6.800%/VAR 21-22.06.31* | USD | 340 000 | 200 000 | | 540 000 | 476 650 | 0,07 |
| ANB SUKUK LTD-REG-S-SUB 3.326%/VAR 20-28.10.30* | USD | 295 000 | | | 295 000 | 254 165 | 0,04 |
| BANCO DAVIVIENDA SA-REG-S-SUB 6.650%/VAR 21-PRP* | USD | 605 000 | | 400 000 | 205 000 | 130 116 | 0,02 |
| BANCO GNB SUDAMERIS SA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 21-16.04.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 154 470 | 0,02 |
| BANCOLOMBIA SA-SUB COCO 4.625%/VAR 19-18.12.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 218 | 0,02 |
| BANK LEUM LE-ISRAEL BM-144A-REG-S-SUB 7.129%/VAR 23-18.07.33* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 444 580 | 0,06 |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 166 179 | 0,02 |
| BANK OF CHINA HONG KONG LTD-REG-S-SUB 5.900%/VAR 18-PRP* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | |
| BANK OF COMMUNICATIONS HK-REG-S 2.304%/VAR 21-08.07.31* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 210 124 | 0,03 |
| BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-PRP* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 220 784 | 0,03 |
| BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.87500%/VAR 20-PRP* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| CASHLD FLR REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 164 760 | 0,02 |
| CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 9.125%/VAR 23-PRP* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 194 389 | 0,03 |
| DIB TIER 1 SUKUK 4 LTD-REG-S-SUB 4.625%/VAR 20-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 172 653 | 0,02 |
| ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S-SUB 4.100%/VAR 20-PRP* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 245 351 | 0,03 |
| EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-PRP* | USD | 410 000 | | | 410 000 | 367 787 | 0,05 |
| FIRST ABU DHABI BANK-REG-S-SUB 4.500%/VAR 20-PRP* | USD | 465 000 | | | 465 000 | 403 774 | 0,06 |
| FIRSTSTRAND BANK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-23.04.28* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | |
| FWD GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 8.045%/VAR 17-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 470 | 0,03 |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES-REG-S-SUB 4.600%/VAR 21-PRP* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 165 729 | 0,02 |
| GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP* | USD | 500 000 | | 210 000 | 290 000 | 250 744 | 0,04 |
| HDFC BANK LTD-REG-S-SUB COCO 3.700%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 165 614 | 0,02 |
| JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD-REG-S 3.900%/VAR 20-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 326 | 0,02 |
| KT21 T2 CO LTD-REG-S-SUB 6.125%/VAR 21-16.12.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 175 105 | 0,02 |
| MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP* | USD | | 375 000 | | 375 000 | 337 551 | 0,05 |
| NATIONAL BK OF FUJAIRAH PJSC-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 282 | 0,03 |
| NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 521 505 | 0,07 |
| NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 166 067 | 0,02 |
| NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB 3.975%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 171 279 | 0,02 |
| OVERSEA-CHINESE BNKNG CORP-REG-S-SUB 4.602%/VAR 22-15.06.32* | USD | 410 000 | | | 410 000 | 360 673 | 0,05 |
| PETRON CORP-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| PETRON CORP-REG-S 5.950%/VAR 21-PRP* | USD | 220 000 | | | 220 000 | 189 732 | 0,03 |
| QIC CAYMAN LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 180 140 | 0,03 |
| RIYAD BANK 3.174%/VAR 20-25.02.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 351 836 | 0,05 |
| ROYAL CAPITAL BV-REG-S 5.000%/VAR 20-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 382 | 0,03 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP* | USD | 280 000 | | | 280 000 | 233 834 | 0,03 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| STANDARD BANK GROUP LTD-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-31.05.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 239 | 0,03 | |
| STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB COCO 4.300%/VAR 21-PRP* | USD | 450 000 | | 200 000 | 250 000 | 185 303 | 0,03 | |
| STANDARD CHARTERED PLC-SUB-REG-S COCO 7.750%/VAR 22-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 182 436 | 0,03 | |
| TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 5.250%/VAR 20-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 172 996 | 0,02 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33* | USD | 2 125 000 | | 450 000 | 1 675 000 | 1 806 164 | 0,26 | |
| TOTAL USD | | | | | | 10 285 406 | 1,46 | |
| Total Anleihen, variabler Zins | | | | | | 10 285 406 | 1,46 | |

Treasury-Notes, fester Zins

| USD | | | | | | | | |
|--|-----|--|-----------|-----------|--|--------------------|--------------|--|
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 22-29.02.24* | USD | | 1 658 000 | 1 658 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | | 0,00 | |
| Total Treasury-Notes, fester Zins | | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 670 964 144 | 95,13 | |

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Treasury-Bills, Nullcoupon

| USD | | | | | | | | |
|--|-----|--|-----------|-----------|--|--|-------------|--|
| UNITED STATES TB 0.00000% 12.12.23-09.04.24* | USD | | 1 500 000 | 1 500 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | | 0,00 | |
| Total Treasury-Bills, Nullcoupon | | | | | | | 0,00 | |

Notes, fester Zins

| USD | | | | | | | | |
|---|-----|-----------|---------|---------|-----------|-----------|------|--|
| ABRA GLOBAL FINANCE-REG-S (PIK) 11.50000% 23-02.03.28* | USD | | 211 280 | | 211 280 | 175 076 | 0,02 | |
| AGROSUPER SA-REG-S 4.60000% 22-20.01.32* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 193 510 | 0,03 | |
| AMAGGI LUXEMBOURG INTERNATIONAL-REG-S 5.25000% 21-28.01.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 377 | 0,02 | |
| AVIANCA MIDCO 2 LTD-REG-S 9.00000% 21-01.12.28* | USD | 980 000 | | 200 000 | 780 000 | 675 542 | 0,10 | |
| BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 205 828 | 0,03 | |
| BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 212 925 | 0,03 | |
| C&W SENIOR FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 17-15.09.27* | USD | 650 000 | | | 650 000 | 554 719 | 0,08 | |
| CAP SA-REG-S 3.90000% 21-27.04.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 141 466 | 0,02 | |
| CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 5.15000% 19-29.01.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 145 294 | 0,02 | |
| CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-REG-S 12.00000% 24-15.02.31* | USD | | 280 000 | | 280 000 | 263 383 | 0,04 | |
| C5N RESOURCES SA REG-S 5.87500% 22-08.04.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 156 510 | 0,02 | |
| DIGICEL GROUP 0.5 LTD-REG-S 8.00000% 20-01.04.25* | USD | 273 009 | | | 273 009 | | | |
| DIGICEL INTERMEDIATE HOLDINGS LTD (PIK) 9.00000% 24-25.05.27* | USD | | 100 | 100 | | | | |
| DIGICEL INTERN FINANCE LTD-144A 8.75000% 20-25.05.24* | USD | 383 106 | | | 383 106 | | | |
| EMBOTELLADORA ANDINA SA-REG-S 5.00000% 13-01.10.23* | USD | 360 000 | | | 360 000 | | | |
| ERO COPPER CORP-REG-S 6.50000% 22-15.02.30* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 170 908 | 0,02 | |
| FLEX LTD 6.00000% 22-15.01.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 183 230 | 0,03 | |
| GRUPO AEROMEXICO SAB DE CV-REG-S 8.50000% 22-17.03.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 676 | 0,03 | |
| INRETAIL CONSUMER-REG-S 3.25000% 21-22.03.28* | USD | 420 000 | | | 420 000 | 338 810 | 0,05 | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP-REG-S 3.82500% 21-26.11.33* | USD | 255 000 | | | 255 000 | 196 232 | 0,03 | |
| INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24* | USD | 370 000 | | | 370 000 | 330 020 | 0,05 | |
| INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 328 756 | 0,05 | |
| INVERSIONES LA CONSTRUCCION SA-REG-S 4.75000% 22-07.02.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 153 851 | 0,02 | |
| INVESTMENT ENERGY RESOURCES LTD-REG-S 6.25000% 21-26.04.29* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 519 479 | 0,07 | |
| LIBERTY COSTA RICA SEN SEC FIN-REG-S 10.87500% 23-15.01.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 189 485 | 0,03 | |
| METALSA SA DE CV-REG-S 3.75000% 21-04.05.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 145 576 | 0,02 | |
| PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50* | USD | 1 210 000 | | | 1 210 000 | 1 081 673 | 0,15 | |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 13-15.11.26* | USD | 805 000 | | 805 000 | | | | |
| PLAYTIKA HOLDING CORP-REG-S 4.25000% 21-15.03.29* | USD | 105 000 | | | 105 000 | 81 874 | 0,01 | |
| POINSETTIA FINANCE LTD-REG-S 6.62500% 16-17.06.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 126 705 | 0,02 | |
| RAS LAFFAN LIQ NATURAL GAS CO LTD-REG-S 6.33200% 06-30.09.27* | USD | 910 000 | | | 910 000 | 539 248 | 0,08 | |
| SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 19-07.09.27* | USD | 365 000 | | | 365 000 | 315 799 | 0,04 | |
| SAMARCO MINERACAO SA-REG-S (PIK) STEP-UP 23-30.06.31* | USD | | 160 000 | | 160 000 | 129 701 | 0,02 | |
| SEASPAR CORP-REG-S 5.50000% 21-01.08.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 157 085 | 0,02 | |
| SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-REG-S 8.87500% 21-15.11.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| SIERRACOL ENERGY ANDINA LLC-REG-S 6.00000% 21-15.06.28* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 315 245 | 0,04 | |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.25000% 19-07.05.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 170 795 | 0,02 | |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.25000% 20-22.01.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 138 933 | 0,02 | |
| SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 16-26.10.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S 9.00000% 23-31.12.50* | USD | | 182 000 | | 182 000 | | | |
| TELEKOM MALAYSIA BHD-REG-S 7.87500% 95-01.08.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 2.62500% 20-15.08.25* | USD | 830 000 | | | 830 000 | 710 389 | 0,10 |
| TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.12500% 20-31.01.25* | USD | 315 000 | | | 315 000 | 284 962 | 0,04 |
| ULTRATECH CEMENT LTD-REG-S 2.80000% 21-16.02.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 151 721 | 0,02 |
| TOTAL USD | | | | | | 9 832 780 | 1,39 |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 9 832 780 | 1,39 |

Notes, variabler Zins

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|---------|---------|----------------|-------------|
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 6.138%/VAR 22-14.09.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| BANCO INDUSTRIAL SA/GUATE-REG-S-SUB 4.875%/VAR 21-29.01.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 171 313 | 0,02 |
| BANCO MERCANTILE-REG-S-SUB COCO 6.625%/VAR 21-PRP* | USD | 380 000 | | | 380 000 | 309 388 | 0,04 |
| TOTAL USD | | | | | | 480 701 | 0,07 |
| Total Notes, variabler Zins | | | | | | 480 701 | 0,07 |

Medium-Term Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|----------------|-------------|
| AXIATA SPV5 LABUAN LTD-REG-S 3.06400% 20-19.08.50* | USD | 924 000 | 200 000 | 400 000 | 724 000 | 436 286 | 0,06 |
| INDIA TOLL ROADS-REG-S-144A 5.50000% 21-19.08.24* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | |
| JSW INFRASTRUCTURE LTD-REG-S 4.95000% 22-21.01.29* | USD | 500 000 | | 500 000 | | | |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 15-18.03.25* | USD | 770 000 | | 770 000 | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 436 286 | 0,06 |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 436 286 | 0,06 |

Anleihen, fester Zins

USD

| | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|------------------|-------------|
| INTERNATIONAL BANK OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.24* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27* | USD | 755 000 | | 500 000 | 255 000 | 206 672 | 0,03 |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | |
| SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S (PIK) 7.95000% 23-15.07.33* | USD | | 983 297 | 140 000 | 843 297 | 695 470 | 0,10 |
| TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 4.00000% 16-15.08.26* | USD | 250 000 | 200 000 | | 450 000 | 383 275 | 0,04 |
| TOTAL USD | | | | | | 1 285 417 | 0,17 |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 1 285 417 | 0,17 |

Anleihen, variabler Zins

USD

| | | | | | | | |
|--|-----|---------|--|---------|--|-------------------|-------------|
| BANCO BILBAO VIZCA ARGENTARIA SA 5.862%/VAR 14.09.22-14.09.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 0,00 | |
| Total Anleihen, variabler Zins | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 12 035 183 | 1,70 |

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

Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|--|-----------|-----------|--|-------------|--|
| DIGICEL INTL FINANC/HOLDINGS-144A 8.75000% 23-25.05.24** | USD | | 383 000 | 383 000 | | | |
| PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 23-19.06.32** | USD | | 400 000 | 400 000 | | | |
| PETROLEOS DEL PERU SA 5.62500% 17-19.06.47** | USD | | 1 230 000 | 1 230 000 | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 0,00 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 0,00 | |

Nicht-Effekten

Treasury-Bills, Nullcoupon

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|--|--|
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.11.22-04.05.23** | USD | | 6 000 000 | 6 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.12.22-04.04.23** | USD | 3 000 000 | | | 3 000 000 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 01.12.22-30.11.23** | USD | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 01.12.22-01.06.23** | USD | | 6 000 000 | 6 000 000 | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 04.04.23-01.08.23** | USD | 6 050 000 | 6 050 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.08.23-01.02.24** | USD | 5 515 000 | 5 515 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 09.05.23-05.09.23** | USD | 8 000 000 | 8 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.06.23-03.10.23** | USD | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 05.09.23-02.01.24** | USD | 6 500 000 | 6 500 000 | | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 0,00 | | |
| Total Treasury-Bills, Nullcoupon | | | | | | 0,00 | | |
| Total Nicht-Effekten | | | | | | 0,00 | | |
| Total Wertschriften | | | | | 682 999 327 | 96,83 | | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | 0,00 | | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | 30 293 347 | 4,30 | | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | -17 733 310 | -2,51 | | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 9 756 410 | 1,38 | | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | 705 315 774 | 100,00 | | |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | -7 675 961 | | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | -5 786 | | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | 697 634 027 | | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 682 999 327 | 96,83 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | -17 733 310 | -2,51 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | - | - |
| TOTAL | 665 266 017 | 94,32 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|----------------------------------|-----------------------|
| Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| USD | 778 911 704 | CHF | 683 710 000 | 02.04.2024 | -17 855 772 | -2.53 |
| USD | 2 824 795 | CHF | 2 495 000 | 02.04.2024 | -49 293 | -0.01 |
| USD | 1 597 801 | CHF | 1 400 000 | 02.04.2024 | -39 140 | -0.01 |
| CHF | 280 000 | USD | 319 676 | 02.04.2024 | 7 932 | 0.00 |
| CHF | 605 000 | USD | 670 463 | 02.04.2024 | -1 114 | 0.00 |
| CHF | 686 720 000 | USD | 758 136 454 | 02.04.2024 | -3 866 496 | -0.55 |
| CHF | 480 000 | USD | 529 743 | 02.04.2024 | -2 861 | 0.00 |
| CHF | 480 000 | USD | 530 181 | 02.04.2024 | -2 466 | 0.00 |
| USD | 772 221 367 | CHF | 697 085 000 | 03.05.2024 | 4 085 173 | 0.58 |
| USD | 532 012 | CHF | 480 000 | 03.05.2024 | 2 567 | 0.00 |
| CHF | 1 985 000 | USD | 2 198 725 | 03.05.2024 | -11 840 | 0.01 |
| | | | | | -17 733 310 | -2.51 |

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.23 | USD | 3 | 0 |
| US LONG BOND FUTURE 21.06.23 | USD | 6 | 0 |
| US LONG BOND FUTURE 20.09.23 | USD | 22 | 22 |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.09.23 | USD | 3 | 3 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.23 | USD | 12 | 12 |
| US LONG BOND FUTURE 19.12.23 | USD | 22 | 22 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23 | USD | 12 | 12 |

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.23 | USD | 7 | 12 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23 | USD | 0 | 12 |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.09.23 | USD | 27 | 27 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.23 | USD | 12 | 12 |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.09.23 | USD | 18 | 18 |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23 | USD | 17 | 17 |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.23 | USD | 27 | 27 |
| US LONG BOND FUTURE 19.12.23 | USD | 4 | 4 |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24 | USD | 12 | 12 |
| US LONG BOND FUTURE 19.03.24 | USD | 4 | 4 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24 | USD | 26 | 26 |

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|-------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| Devisentermingeschäfte | | | | |
| CHF | 3 935 000 | USD | 4 311 724 | 02.05.2023 |
| CHF | 895 000 | USD | 1 010 575 | 02.05.2023 |
| USD | 817 614 105 | CHF | 725 200 000 | 02.06.2023 |
| CHF | 2 840 000 | USD | 3 188 450 | 02.06.2023 |
| USD | 263 556 | CHF | 235 000 | 02.06.2023 |
| USD | 23 017 198 | CHF | 20 535 000 | 02.06.2023 |
| USD | 350 362 | CHF | 315 000 | 02.06.2023 |
| USD | 810 277 613 | CHF | 737 855 000 | 05.07.2023 |
| USD | 398 687 | CHF | 360 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 7 280 000 | USD | 8 098 385 | 05.07.2023 |
| CHF | 780 000 | USD | 867 279 | 05.07.2023 |
| USD | 896 916 | CHF | 805 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 685 000 | USD | 1 876 463 | 02.08.2023 |
| USD | 829 439 933 | CHF | 739 950 000 | 02.08.2023 |
| USD | 853 681 | CHF | 765 000 | 02.08.2023 |
| USD | 1 354 214 | CHF | 1 210 000 | 02.08.2023 |
| USD | 323 560 | CHF | 290 000 | 02.08.2023 |
| CHF | 250 000 | USD | 282 099 | 02.08.2023 |
| CHF | 13 300 000 | USD | 15 519 650 | 02.08.2023 |
| CHF | 415 000 | USD | 479 529 | 02.08.2023 |
| USD | 849 943 331 | CHF | 734 170 000 | 05.09.2023 |
| USD | 1 371 507 | CHF | 1 200 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 340 000 | USD | 390 230 | 05.09.2023 |
| USD | 1 022 498 | CHF | 900 000 | 05.09.2023 |
| USD | 824 553 833 | CHF | 726 065 000 | 03.10.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|----------------------------|---------------------------|-------------------------|------------------------|-------------------|
| CHF | 225 000 | USD | 253 400 | 03.10.2023 |
| USD | 511 305 | CHF | 455 000 | 03.10.2023 |
| CHF | 660 000 | USD | 740 477 | 03.10.2023 |
| USD | 11 224 397 | CHF | 10 050 000 | 03.10.2023 |
| USD | 783 160 342 | CHF | 714 160 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 400 000 | USD | 437 091 | 02.11.2023 |
| CHF | 495 000 | USD | 544 089 | 02.11.2023 |
| USD | 740 178 | CHF | 670 000 | 02.11.2023 |
| USD | 774 835 554 | CHF | 702 765 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 750 000 | USD | 841 293 | 04.12.2023 |
| CHF | 445 000 | USD | 503 488 | 04.12.2023 |
| CHF | 30 228 015 | USD | 34 200 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 155 000 | USD | 176 841 | 04.12.2023 |
| USD | 813 294 097 | CHF | 704 760 000 | 03.01.2024 |
| USD | 1 809 368 | CHF | 1 580 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 420 000 | USD | 481 927 | 03.01.2024 |
| CHF | 1 180 000 | USD | 1 342 021 | 03.01.2024 |
| CHF | 29 965 000 | USD | 34 352 659 | 03.01.2024 |
| CHF | 690 000 | USD | 795 162 | 03.01.2024 |
| CHF | 2 085 000 | USD | 2 406 221 | 03.01.2024 |
| CHF | 535 000 | USD | 619 941 | 03.01.2024 |
| USD | 650 220 | CHF | 560 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 672 025 000 | USD | 803 526 057 | 03.01.2024 |
| CHF | 600 000 | USD | 719 076 | 02.02.2024 |
| USD | 836 038 046 | CHF | 697 030 000 | 02.02.2024 |
| CHF | 13 430 000 | USD | 15 850 984 | 02.02.2024 |
| CHF | 655 000 | USD | 772 746 | 02.02.2024 |
| USD | 3 232 699 | CHF | 2 755 000 | 02.02.2024 |
| USD | 846 788 | CHF | 735 000 | 02.02.2024 |
| USD | 4 131 240 | CHF | 3 565 000 | 02.02.2024 |
| USD | 796 055 602 | CHF | 680 575 000 | 04.03.2024 |
| CHF | 275 000 | USD | 316 014 | 04.03.2024 |
| USD | 1 379 249 | CHF | 1 205 000 | 04.03.2024 |
| CHF | 1 620 000 | USD | 1 829 547 | 04.03.2024 |
| USD | 778 911 704 | CHF | 683 710 000 | 02.04.2024 |
| USD | 2 824 795 | CHF | 2 495 000 | 02.04.2024 |
| USD | 1 597 801 | CHF | 1 400 000 | 02.04.2024 |
| CHF | 280 000 | USD | 319 676 | 02.04.2024 |
| CHF | 605 000 | USD | 670 463 | 02.04.2024 |
| CHF | 686 720 000 | USD | 758 136 454 | 02.04.2024 |
| CHF | 480 000 | USD | 529 743 | 02.04.2024 |
| CHF | 480 000 | USD | 530 181 | 02.04.2024 |
| USD | 772 221 367 | CHF | 697 085 000 | 03.05.2024 |
| USD | 532 012 | CHF | 480 000 | 03.05.2024 |
| CHF | 1 985 000 | USD | 2 198 725 | 03.05.2024 |

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

| Position | Betrag in CHF | in % des Nettofonds- vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Brutto Gesamtengagement aus Derivaten | 697 999 359,88 | 100,05 |
| Netto Gesamtengagement aus Derivaten | – | – |
| Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften | – | – |

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Das Teilvermögen darf keine Pensionsgeschäfte tätigen.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Bonds Emerging Markets Aggregate Passive
(CHF hedged) II

Klasse I-A1

0,30%

Klasse I-B

0,06%

Klasse I-X

0,00%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurs

USD 1 = CHF 0.90

Übersicht aktiver Anlageverstoß gem. KKV, Artikel 70_2b

Aufgrund eines technischen Problems gab es einen Leerverkauf einer Obligation per 14.12.2023. Der aktive Anlageverstoß gegen den Fondsvertrag wurde umgehend behoben. Der kollektiven Kapitalanlage ist hieraus kein Schaden entstanden.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|-------------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 156 063 636.31 | 205 082 891.01 | 152 019 798.78 |
| Klasse I-X | CH0259022512 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 869.59 | 830.00 | 946.48 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 179 467,2660 | 247 086,4950 | 160 615,9280 |

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|--|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-X | CHF | 6.8% | -10.4% | -8.1% |
| Benchmark: | | | | |
| JPM EMBI Global Diversified (CHF hedged) | CHF | 6.4% | -10.5% | -8.5% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|------------------------------|--------------|
| Saudi-Arabien | 4,76 |
| Mexiko | 4,76 |
| Indonesien | 4,38 |
| Türkei | 4,34 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 3,93 |
| China | 3,68 |
| Brasilien | 3,25 |
| Katar | 3,19 |
| Oman | 3,00 |
| Chile | 3,00 |
| Übrige | 58,28 |
| TOTAL | 96,57 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 7 097 956.70 | 206 222 152.60 |
| Geldmarktinstrumente | 0.00 | 1 911 363.07 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 152 596 243.06 | 196 415 988.68 |
| Derivative Finanzinstrumente | -3 919 319.47 | 4 407 141.37 |
| Sonstige Vermögenswerte | 2 236 079.24 | 2 857 430.72 |
| Gesamtfondsvermögen | 158 010 959.53 | 411 814 076.44 |
| Aufgenommene Kredite | -1 947 092.57 | -206 730 977.29 |
| Andere Verbindlichkeiten | -230.65 | -208.14 |
| Nettofondsvermögen | 156 063 636.31 | 205 082 891.01 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 75 973.19 | 6 771.55 |
| Negativzinsen | -2 305.33 | -783.89 |
| Erträge der Geldmarktinstrumente | 45 452.04 | 5 830.14 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 10 413 544.99 | 9 446 392.85 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 798 627.10 | 2 226 619.93 |
| TOTAL Ertrag | 11 331 291.99 | 11 684 830.58 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | -1 219.21 | -460.85 |
| Prüfaufwand | -14 146.40 | -14 684.90 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -2 808.90 | -767.63 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -2 981 265.52 | -177 841.71 |
| TOTAL Aufwand | -2 999 440.03 | -193 755.09 |
| Nettoertrag | 8 331 851.96 | 11 491 075.49 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -16 427 745.57 | -12 203 949.00 |
| Realisierter Erfolg | -8 095 893.61 | -712 873.51 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 16 394 495.38 | -12 989 806.11 |
| Gesamterfolg | 8 298 601.77 | -13 702 679.62 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 8 331 851.96 | 11 491 075.49 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 8 331 851.96 | 11 491 075.49 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer ¹ | -2 916 148.19 | -4 021 876.42 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -5 415 703.77 | -7 469 199.07 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 205 082 891.01 | 152 019 798.78 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -4 021 983.20 | -3 427 701.47 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | -53 295 873.27 | 70 193 473.32 |
| Gesamterfolg | 8 298 601.77 | -13 702 679.62 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 156 063 636.31 | 205 082 891.01 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 247 086,4950 | 160 615,9280 |
| Ausgegebene Anteile | 27 836,8920 | 94 048,8730 |
| Zurückgenommene Anteile | -95 456,1210 | -7 578,3060 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 179 467,2660 | 247 086,4950 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -67 619,2290 | 86 470,5670 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

| Klasse I-X | | |
|---|------------|---------------|
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 46.425 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹ | CHF | -16.249 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 30.176 |

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizilierte Anleger gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs.1 VStV

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal | |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | | |
| Notes, fester Zins | | | | | | | | |
| USD | | | | | | | | |
| ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | 168 938 | 0,11 | | |
| ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 4.12500% 17-11.10.47* | USD | 400 000 | | 200 000 | 151 937 | 0,10 | | |
| AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUM-REG-S 4.00000% 21-11.08.41* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 5.12500% 21-11.08.61* | USD | 200 000 | | 200 000 | 131 164 | 0,08 | | |
| ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 8.75000% 22-14.04.32* | USD | 500 000 | 400 000 | 400 000 | 414 322 | 0,26 | | |
| ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48* | USD | 700 000 | | 230 000 | 365 254 | 0,23 | | |
| ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.30* | USD | 1 359 305 | 200 000 | 200 000 | 635 502 | 0,40 | | |
| ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.35* | USD | 2 807 521 | 1 114 000 | 1 581 000 | 872 756 | 0,55 | | |
| ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.01.38* | USD | 2 085 306 | 490 000 | 1 250 000 | 552 685 | 0,35 | | |
| ARGENTINA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-09.07.29* | USD | 471 568 | 160 000 | 100 000 | 255 251 | 0,16 | | |
| ARGENTINE REPUBLIC GOVT INTERNATIONAL STEP-UP 20-09.07.46* | USD | 1 660 000 | | 1 000 000 | 266 913 | 0,17 | | |
| ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.60000% 21-02.02.31* | USD | 200 000 | 200 000 | | 291 827 | 0,18 | | |
| ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.95000% 19-26.09.29* | USD | 409 000 | | 409 000 | | | | |
| BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 15-26.01.26* | USD | 655 000 | | 200 000 | 414 695 | 0,26 | | |
| BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 2.70400% 20-09.01.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| BANCO NACIONAL DE PANAMA-REG-S 2.50000% 20-11.08.30* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 139 834 | 0,09 | | |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO-REG-S 6.25000% 23-31.10.28* | USD | | 470 000 | 200 000 | 275 841 | 0,16 | | |
| BAPCO ENERGIES BSICC-REG-S 7.50000% 17-25.10.27* | USD | 400 000 | | 200 000 | 184 869 | 0,12 | | |
| BAPCO ENERGIES BSICC-REG-S 8.37500% 18-07.11.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | 193 988 | 0,12 | | |
| BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 7.96000% 24-13.02.38* | USD | | 200 000 | 200 000 | 175 468 | 0,11 | | |
| BLOSSOM JOY LTD-REG-S 2.20000% 20-21.10.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | 152 454 | 0,10 | | |
| BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 17-20.03.28* | USD | 400 000 | 200 000 | 200 000 | 208 962 | 0,13 | | |
| BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 22-02.03.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | 107 859 | 0,07 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 3.87500% 20-12.06.30* | USD | 400 000 | 200 000 | 600 000 | 487 189 | 0,31 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 2.87500% 20-06.06.25* | USD | 900 000 | 200 000 | 200 000 | 782 621 | 0,50 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 6.00000% 23-20.10.33* | USD | | 500 000 | 500 000 | 445 621 | 0,28 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 7.12500% 24-13.05.54* | USD | | 200 000 | 200 000 | 181 581 | 0,11 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 5.62500% 09-07.01.41* | USD | 905 000 | 280 000 | 560 000 | 507 459 | 0,32 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25* | USD | 550 000 | | 200 000 | 310 657 | 0,20 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28* | USD | 550 000 | 200 000 | 200 000 | 485 477 | 0,31 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 4.75000% 19-14.01.50* | USD | 1 070 000 | | 200 000 | 586 140 | 0,37 | | |
| BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 6.25000% 23-18.03.31* | USD | | 400 000 | 400 000 | 366 945 | 0,23 | | |
| BRAZIL, REPUBLIC OF 3.75000% 21-12.09.31* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| CBB INTERNATIONAL SUKUK-REG-S 5.25000% 17-20.03.25* | USD | 620 000 | | 620 000 | 552 883 | 0,35 | | |
| CBB INTERNATIONAL SUKUK CO 7SPC-REG-S 6.87500% 18-05.10.25* | USD | 600 000 | | 280 000 | 292 277 | 0,18 | | |
| CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 3.87500% 21-18.05.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | 164 603 | 0,10 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 20-27.01.32* | USD | 420 000 | | 200 000 | 167 502 | 0,11 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 2.45000% 20-31.01.31* | USD | 285 000 | | 285 000 | 219 719 | 0,14 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 21-27.07.33* | USD | 400 000 | 230 000 | | 461 721 | 0,29 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 2.75000% 22-31.01.27* | USD | | 560 000 | 560 000 | 473 340 | 0,30 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.86000% 17-21.06.47* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50* | USD | 520 000 | | 520 000 | | | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-22.01.61* | USD | 420 000 | 260 000 | 200 000 | 113 601 | 0,07 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-07.05.41* | USD | 406 000 | 200 000 | 400 000 | 137 292 | 0,09 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.25000% 21-21.09.71* | USD | 290 000 | 330 000 | 200 000 | 239 035 | 0,15 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 22-31.01.34* | USD | 250 000 | | 250 000 | 197 507 | 0,12 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 21-15.04.53* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 4.00000% 22-31.01.52* | USD | 200 000 | | 200 000 | 142 367 | 0,09 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 4.34000% 22-07.03.42* | USD | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 157 228 | 0,10 | | |
| CHILE, REPUBLIC OF 4.95000% 23-05.01.36* | USD | | 612 307 | 400 000 | 212 307 | 185 189 | 0,12 | |
| CHILE, REPUBLIC OF 4.85000% 24-22.01.29* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| CHINA HUANENG GP HK TREASURY MGT-REG-S 3.00000% 19-10.12.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 0.55000% 20-21.10.25* | USD | 200 000 | | 200 000 | 168 334 | 0,11 | | |
| CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 21-26.10.31* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 4.00000% 18-19.10.48* | USD | 410 000 | | 410 000 | 335 290 | 0,21 | | |
| CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.37500% 19-19.06.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | 179 183 | 0,11 | | |
| CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 2.00000% 20-22.09.25* | USD | | 200 000 | 200 000 | 170 922 | 0,11 | | |
| CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.00000% 20-22.09.30* | USD | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 157 831 | 0,10 | | |
| CNOOC CURTIS FUNDING NO.1 PTY LTD-REG-S 4.50000% 13-03.10.23* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| CNP GLOBAL CAPITAL LTD-REG-S 1.35000% 20-23.06.25* | USD | 200 000 | | 200 000 | 171 427 | 0,11 | | |
| COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.25000% 21-22.04.32* | USD | 850 000 | | 400 000 | 315 335 | 0,20 | | |
| COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.12500% 21-22.02.42* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | | | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.875000% 17-25.04.27* | USD | 400 000 | | 200 000 | | | 169 422 | 0,11 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.500000% 18-15.03.29* | USD | 370 000 | | | | 370 000 | 306 098 | 0,19 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.200000% 19-15.05.49* | USD | 400 000 | 750 000 | 210 000 | | 940 000 | 620 177 | 0,39 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.000000% 20-30.01.30* | USD | 400 000 | | 200 000 | | 200 000 | 149 066 | 0,09 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.125000% 20-15.04.31* | USD | 400 000 | 200 000 | | | 600 000 | 430 985 | 0,27 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.125000% 20-15.05.51* | USD | 430 000 | 220 000 | 650 000 | | | | | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.875000% 21-15.02.61* | USD | 335 000 | 420 000 | 555 000 | | 200 000 | 103 941 | 0,07 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.500000% 23-02.02.34* | USD | 400 000 | | | | 400 000 | 367 666 | 0,23 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.000000% 23-14.11.35* | USD | | 250 000 | | | 250 000 | 236 434 | 0,15 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.750000% 23-14.11.53* | USD | | 200 000 | | | 200 000 | 195 362 | 0,12 | |
| COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.750000% 16-23.02.27* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 174 939 | 0,11 | |
| COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.348000% 21-09.02.31* | USD | 410 000 | | 410 000 | | | | | |
| COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 6.264000% 22-15.02.52* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 156 271 | 0,10 | |
| CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.750000% 15-15.07.25* | USD | 169 000 | | | | 169 000 | 150 533 | 0,10 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.250000% 12-17.07.42* | USD | 655 000 | | | | 655 000 | 465 437 | 0,29 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.500000% 17-01.08.47* | USD | | 200 000 | | | 200 000 | 141 973 | 0,09 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.375000% 19-05.02.49* | USD | 400 000 | | | | 400 000 | 280 230 | 0,18 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.000000% 19-30.09.29* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 159 424 | 0,10 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.700000% 19-30.01.50* | USD | 435 000 | | | | 435 000 | 269 488 | 0,17 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.750000% 20-15.01.31* | USD | 600 000 | | 310 000 | | 290 000 | 232 389 | 0,15 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE-REG-S 5.125000% 23-02.02.33* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.440000% 24-26.01.36* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.375000% 13-30.04.25* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | | 200 000 | 177 719 | 0,11 | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.625000% 13-30.04.43* | USD | 600 000 | 200 000 | 400 000 | | 400 000 | 325 378 | 0,21 | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.000000% 14-04.04.44* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.158000% 15-12.03.45* | USD | 340 000 | 210 000 | 550 000 | | | | | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.125000% 19-19.02.31* | USD | 400 000 | | | | 400 000 | 364 558 | 0,23 | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.550000% 23-03.04.34* | USD | 200 000 | 830 000 | 670 000 | | 360 000 | 335 601 | 0,21 | |
| DAE FUNDING LLC-REG-S 3.375000% 21-20.03.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 2.950000% 21-06.05.31* | USD | 400 000 | | 200 000 | | 200 000 | 149 516 | 0,09 | |
| DOMINICAN REPUBLIC INT BOND-REG-S 4.875000% 20-23.09.32* | USD | 826 000 | 150 000 | 476 000 | | 500 000 | 403 767 | 0,26 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.500000% 15-27.01.25* | USD | 335 000 | 160 000 | 250 000 | | 245 000 | 218 906 | 0,14 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.850000% 15-27.01.45* | USD | 690 000 | | 520 000 | | 170 000 | 151 358 | 0,10 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.875000% 16-29.01.26* | USD | 250 000 | 210 000 | | | 460 000 | 418 258 | 0,26 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.950000% 17-25.01.27* | USD | 500 000 | | 200 000 | | 300 000 | 268 589 | 0,17 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.500000% 18-15.02.48* | USD | 365 000 | 200 000 | 200 000 | | 365 000 | 312 626 | 0,20 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.000000% 18-19.07.28* | USD | 655 000 | 170 000 | 600 000 | | 225 000 | 201 644 | 0,13 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.400000% 19-05.06.49* | USD | 305 000 | 150 000 | | | 455 000 | 384 973 | 0,24 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 4.500000% 20-30.01.30* | USD | 570 000 | 300 000 | 300 000 | | 570 000 | 466 423 | 0,30 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.875000% 20-30.01.60* | USD | 1 031 000 | | 490 000 | | 541 000 | 414 339 | 0,26 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.300000% 21-21.01.41* | USD | 495 000 | 410 000 | 320 000 | | 585 000 | 448 038 | 0,28 | |
| DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 5.250000% 13-30.01.43* | USD | 400 000 | | | | 400 000 | 345 869 | 0,22 | |
| ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35* | USD | 2 556 000 | 440 000 | 1 000 000 | | 1 996 000 | 942 046 | 0,60 | |
| ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.500000% 20-31.07.30* | USD | 1 541 460 | 100 000 | 641 000 | | 1 000 460 | 610 054 | 0,39 | |
| ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40* | USD | 1 661 226 | | 1 235 000 | | 426 226 | 186 000 | 0,12 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.875000% 10-30.04.40* | USD | 160 000 | 240 000 | 400 000 | | | | | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.903000% 18-21.02.48* | USD | 350 000 | | | | 350 000 | 239 389 | 0,15 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.588000% 18-21.02.28* | USD | 540 000 | 200 000 | 500 000 | | 240 000 | 197 456 | 0,12 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.625000% 20-29.05.32* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.875000% 20-29.05.50* | USD | 600 000 | 300 000 | 575 000 | | 325 000 | 240 677 | 0,15 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.625000% 11-01.02.41* | USD | 180 000 | | | | 180 000 | 118 676 | 0,08 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.375000% 14-18.01.27* | USD | 235 000 | 50 000 | 100 000 | | 185 000 | 144 968 | 0,09 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.625000% 17-28.02.29* | USD | 310 000 | 250 000 | 430 000 | | 130 000 | 101 796 | 0,06 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.124600% 19-20.01.50* | USD | 370 000 | | | | 370 000 | 229 740 | 0,15 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.500000% 20-15.07.52* | USD | 520 000 | | 200 000 | | 320 000 | 239 676 | 0,15 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.250000% 02-10.04.32* | USD | 105 000 | 150 000 | 100 000 | | 155 000 | 116 084 | 0,07 | |
| EMPRESA DE L FERROCARRILE DEL EST-REG-S 3.068000% 20-18.08.50* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 109 041 | 0,07 | |
| EMPRESA DE TRANSMISION ELECTRICA-REG-S 5.125000% 19-02.05.49* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 130 714 | 0,08 | |
| EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 5.000000% 17-25.01.47* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 155 934 | 0,10 | |
| EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 3.650000% 20-07.05.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJERO-REG-S 3.693000% 21-13.09.61* | USD | | 200 000 | | | 200 000 | 120 243 | 0,08 | |
| EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.500000% 17-14.09.47* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.250000% 18-06.11.29* | USD | 350 000 | | | | 350 000 | 306 970 | 0,19 | |
| ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.750000% 13-06.08.23* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.125000% 15-11.02.25* | USD | 340 000 | | | | 340 000 | 304 860 | 0,19 | |
| FONDO MIVIENDA SA-REG-S 4.625000% 22-12.04.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.625000% 20-06.02.31* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| GABON, REPUBLIC OF-REG-S 7.000000% 21-24.11.31* | USD | 400 000 | | 200 000 | | 200 000 | 153 400 | 0,10 | |
| GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.250000% 22-13.10.32* | USD | 200 000 | 200 000 | | | 400 000 | 364 108 | 0,23 | |
| GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.000000% 22-13.10.27* | USD | 200 000 | | | | 200 000 | 179 521 | 0,11 | |
| GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.375000% 22-13.10.2122* | USD | 200 000 | 400 000 | 200 000 | | 400 000 | 310 107 | 0,20 | |

| Titel | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon |
|---|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | | | | | | ausgeliehen |
| | | | | | | | Anzahl/ Nominal |
| GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 4.75000% 23-14.02.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | 176 537 | 0,11 | |
| GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 4.87500% 23-14.02.35* | USD | 230 000 | 230 000 | | | | |
| GEORGIA GOVERNMENT INTERNAT BOND-REG-S 2.75000% 21-22.04.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 167 586 | 0,11 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.62500% 18-16.05.29* | USD | 400 000 | 200 000 | 200 000 | 92 547 | 0,06 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49* | USD | 500 000 | | 500 000 | 226 582 | 0,14 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 6.37500% 20-11.02.27* | USD | 400 000 | | 400 000 | 185 206 | 0,12 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62500% 21-07.04.34* | USD | 200 000 | | 200 000 | 92 660 | 0,06 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.87500% 21-07.05.42* | USD | 200 000 | 200 000 | | | | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.75000% 21-07.04.29* | USD | 500 000 | 200 000 | 300 000 | 140 003 | 0,09 | |
| GUATEMALA GOVERNMENT BOND-REG-S 4.65000% 21-07.10.41* | USD | 240 000 | | 240 000 | 173 677 | 0,11 | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 13-13.02.28* | USD | 555 000 | 210 000 | 345 000 | 299 726 | 0,19 | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26* | USD | | 200 000 | 200 000 | 175 186 | 0,11 | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 17-05.06.27* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.90000% 19-01.06.30* | USD | 200 000 | 200 000 | | | | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-01.06.50* | USD | 600 000 | 200 000 | 400 000 | 333 799 | 0,21 | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32* | USD | | 400 000 | 200 000 | 173 079 | 0,11 | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 3.70000% 21-07.10.33* | USD | 235 000 | 210 000 | 200 000 | 182 369 | 0,12 | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 22-10.08.29* | USD | 200 000 | 200 000 | | | | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.60000% 23-13.06.36* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | |
| GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 7.05000% 23-04.10.32* | USD | | 200 000 | 200 000 | 191 174 | 0,12 | |
| HERITAGE PETROLEUM CO LTD-REG-S 9.00000% 22-12.08.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | 189 372 | 0,12 | |
| HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27* | USD | 150 000 | 200 000 | 350 000 | | | |
| HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 20-24.06.30* | USD | 300 000 | | 300 000 | 240 107 | 0,15 | |
| HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 13-15.03.24* | USD | 200 000 | 200 000 | | | | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF 7.62500% 11-29.03.41* | USD | 940 000 | 80 000 | 460 000 | 583 361 | 0,37 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF 5.75000% 13-22.11.23* | USD | 114 000 | 114 000 | | | | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24* | USD | 38 000 | 38 000 | | | | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 22-16.06.29* | USD | 960 000 | 620 000 | 340 000 | 303 176 | 0,19 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 22-16.06.34* | USD | 420 000 | 200 000 | 620 000 | | | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 2.12500% 21-22.09.31* | USD | 800 000 | 760 000 | 200 000 | 1 360 000 | 0,62 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 21-21.09.51* | USD | 850 000 | 200 000 | 400 000 | 650 000 | 0,23 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 23-22.05.28* | USD | 330 000 | 400 000 | 430 000 | 300 000 | 0,18 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 22-22.09.32* | USD | 500 000 | 200 000 | 700 000 | 655 907 | 0,42 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 22-25.09.52* | USD | 200 000 | | 200 000 | 193 485 | 0,12 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 24-26.03.36* | USD | | 200 000 | 200 000 | 175 017 | 0,11 | |
| INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28* | USD | 250 000 | 250 000 | | | | |
| INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT-REG-S 5.80000% 20-15.05.50* | USD | 200 000 | | 200 000 | 169 351 | 0,11 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28* | USD | 200 000 | 200 000 | 400 000 | 341 873 | 0,22 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 4.35000% 17-11.01.48* | USD | | 240 000 | 240 000 | 189 316 | 0,12 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 4.75000% 18-11.02.29* | USD | 440 000 | 440 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 5.35000% 18-11.02.49* | USD | 200 000 | | 200 000 | 181 538 | 0,11 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 3.70000% 19-30.10.49* | USD | 285 000 | 285 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 2.85000% 20-14.02.30* | USD | 200 000 | 200 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 3.85000% 20-15.10.30* | USD | 400 000 | 400 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 3.05000% 21-12.03.51* | USD | 340 000 | | 340 000 | 217 046 | 0,14 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 3.35000% 21-12.03.71* | USD | 215 000 | 210 000 | 425 000 | 254 082 | 0,16 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 3.20000% 21-23.09.61* | USD | 220 000 | 220 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 4.30000% 22-31.03.52* | USD | 200 000 | | 200 000 | 154 277 | 0,10 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 4.65000% 22-20.09.32* | USD | 400 000 | 230 000 | 630 000 | 552 387 | 0,35 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38* | USD | 300 000 | 110 000 | 410 000 | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42* | USD | 400 000 | 250 000 | 650 000 | 586 995 | 0,37 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.35000% 16-08.01.27* | USD | 450 000 | 400 000 | 850 000 | 752 802 | 0,48 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47* | USD | 410 000 | 200 000 | 210 000 | 189 571 | 0,12 | |
| INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43* | USD | 200 000 | | 200 000 | 160 831 | 0,10 | |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32* | USD | 300 000 | 300 000 | | | | |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 24-30.01.33* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 178 789 | 0,11 | |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 24-30.01.37* | USD | 500 000 | | 500 000 | 450 913 | 0,29 | |
| JAMAICA, GOVERNMENT OF 6.75000% 15-28.04.28* | USD | 400 000 | 400 000 | | | | |
| JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45* | USD | 600 000 | | 600 000 | 635 838 | 0,40 | |
| JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL B-REG-S 7.75000% 22-15.01.28* | USD | 200 000 | 410 000 | 410 000 | 182 730 | 0,12 | |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 6.12500% 15-29.01.26* | USD | 210 000 | 210 000 | | | | |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27* | USD | 470 000 | 260 000 | 200 000 | 530 000 | 0,29 | |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.85000% 20-07.07.30* | USD | 700 000 | 200 000 | 330 000 | 570 000 | 0,30 | |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 4.95000% 20-07.07.25* | USD | 210 000 | | 210 000 | 183 591 | 0,12 | |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.50000% 23-13.01.29* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | |
| JSC GEORGIAN RAILWAY-REG-S 4.00000% 21-17.06.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | 163 436 | 0,10 | |
| KAZTRANS GAS JSC-REG-S 4.37500% 17-26.09.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | 169 670 | 0,11 | |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 9.75000% 24-16.02.31* | USD | | 410 000 | 410 000 | 377 596 | 0,24 | |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 14-24.06.24* | USD | 650 000 | 650 000 | | | | |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 18-28.02.28* | USD | 600 000 | 200 000 | 200 000 | 515 890 | 0,33 | |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48* | USD | 250 000 | | 250 000 | 193 651 | 0,12 | |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.00000% 19-22.05.32* | USD | 400 000 | 400 000 | 800 000 | | | |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 19-22.05.27* | USD | 275 000 | 220 000 | 495 000 | | | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal |
| KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.30000% 21-23.01.34* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 294 529 | 0,19 | |
| KSA SUKUK LTD-REG-S 2.25000% 21-17.05.31* | USD | 495 000 | 340 000 | 570 000 | 265 000 | 201 913 | 0,13 | |
| KSA SUKUK LTD-REG-S 5.26800% 22-25.10.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27* | USD | 1 640 000 | 700 000 | 1 220 000 | 1 120 000 | 979 466 | 0,62 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-26.02.30* | USD | 770 000 | 250 000 | 469 000 | 551 000 | 32 507 | 0,02 | |
| MAGYAR EXPORT-IMPORT BANK ZRT-REG-S 6.12500% 23-04.12.27* | USD | | 450 000 | 200 000 | 250 000 | 226 582 | 0,14 | |
| MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK BHD-REG-S 3.04300% 15-22.04.25* | USD | 265 000 | | 265 000 | | | | |
| MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK BHD-REG-S 4.23600% 15-22.04.45* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD-REG-S 9.87500% 21-08.04.2026* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 154 357 | 0,10 | |
| MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.50000% 22-28.04.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 186 317 | 0,12 | |
| MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | | |
| MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.65900% 20-24.05.31* | USD | 285 000 | 400 000 | 400 000 | 285 000 | 214 087 | 0,14 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40* | USD | 252 000 | | 252 000 | | | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.2110* | USD | 286 000 | 100 000 | 290 000 | 96 000 | 75 713 | 0,05 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 175 299 | 0,11 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.15000% 17-28.03.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48* | USD | 285 000 | 200 000 | | 485 000 | 350 837 | 0,22 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 18-11.01.28* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 214 127 | 0,14 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 285 | 0,11 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.25000% 20-16.04.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 320 829 | 0,20 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 20-27.04.32* | USD | 600 000 | | 300 000 | 300 000 | 256 362 | 0,16 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 5.00000% 20-27.04.51* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 303 536 | 0,19 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.77100% 20-24.05.61* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 117 316 | 0,07 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.28000% 21-14.08.41* | USD | 420 000 | 200 000 | | 620 000 | 448 981 | 0,28 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.50000% 22-12.02.34* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 150 192 | 0,10 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.40000% 22-12.02.52* | USD | 440 000 | 200 000 | 400 000 | 240 000 | 165 571 | 0,10 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.87500% 22-19.05.33* | USD | | 520 000 | | 520 000 | 444 068 | 0,28 | |
| MFB MAGYAR FEJLESZTESI BANK-REG-S 6.50000% 23-29.06.28* | USD | | 650 000 | 400 000 | 250 000 | 228 834 | 0,14 | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.65000% 23-19.01.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 7.87500% 23-05.06.29* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 185 789 | 0,12 | |
| MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.00000% 20-15.12.50* | USD | 405 000 | | 200 000 | 205 000 | 126 250 | 0,08 | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 2.37500% 20-15.12.27* | USD | 200 000 | 250 000 | | 450 000 | 361 237 | 0,23 | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 3.00000% 20-15.12.32* | USD | 640 000 | 210 000 | 200 000 | 650 000 | 470 559 | 0,30 | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 5.95000% 23-08.03.28* | USD | 220 000 | 200 000 | 420 000 | | | | |
| MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 6.50000% 23-08.09.33* | USD | | 420 000 | 420 000 | | | | |
| MOZAMBIQUE INT BOND-REG-S STEP-UP 19-15.09.31* | USD | 247 000 | 200 000 | 210 000 | 237 000 | 182 647 | 0,12 | |
| MVM ENERGETIKA ZRT-REG-S 7.50000% 23-09.06.28* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 280 934 | 0,18 | |
| NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 7.62500% 19-08.11.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 108 985 | 0,07 | |
| NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 15-29.10.25* | USD | 405 000 | | 200 000 | 205 000 | 182 723 | 0,12 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32* | USD | 630 000 | 300 000 | 710 000 | 220 000 | 179 515 | 0,11 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30* | USD | 530 000 | 200 000 | 320 000 | 410 000 | 335 359 | 0,21 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38* | USD | 530 000 | 300 000 | 610 000 | 220 000 | 162 858 | 0,10 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 359 267 | 0,23 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31* | USD | 450 000 | | | 450 000 | 391 762 | 0,25 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 164 941 | 0,10 | |
| NOGAHOLDING SUKUK LTD-REG-S 6.62500% 23-25.05.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 188 246 | 0,12 | |
| NPC UKRENERGO-REG-S 6.87500% 21-09.11.28* | USD | 210 000 | | | 210 000 | 70 268 | 0,04 | |
| OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 7.00000% 21-25.01.51* | USD | 400 000 | | 200 000 | 200 000 | 189 710 | 0,12 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26* | USD | 625 000 | 200 000 | 400 000 | 425 000 | 376 099 | 0,24 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27* | USD | 1 010 000 | | 720 000 | 290 000 | 259 897 | 0,16 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47* | USD | 500 000 | 420 000 | 411 000 | 509 000 | 462 181 | 0,29 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28* | USD | 200 000 | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 361 944 | 0,23 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48* | USD | 520 000 | 450 000 | 410 000 | 560 000 | 516 687 | 0,33 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.93200% 18-31.10.25* | USD | 225 000 | 200 000 | 200 000 | 225 000 | 203 734 | 0,13 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 21-25.01.31* | USD | 600 000 | 200 000 | 400 000 | 400 000 | 373 002 | 0,24 | |
| OMAN SOVEREIGN SUKUK SAOC-REG-S 4.39700% 17-01.06.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| PAKISTAN WATER & POWER DEVEL AUTH-REG-S 7.50000% 21-04.06.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 134 350 | 0,09 | |
| PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25* | USD | | 250 000 | 250 000 | | | | |
| PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27* | USD | 475 000 | 400 000 | 400 000 | 475 000 | 363 705 | 0,23 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 17-15.05.47* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 248 143 | 0,16 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.16000% 19-23.01.30* | USD | 480 000 | | 280 000 | 200 000 | 149 572 | 0,09 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.87000% 19-23.07.60* | USD | 600 000 | 220 000 | 590 000 | 230 000 | 119 118 | 0,08 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 20-01.04.56* | USD | 400 000 | 200 000 | | 600 000 | 349 922 | 0,22 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 2.25200% 20-29.09.32* | USD | 897 000 | 760 000 | 200 000 | 1 457 000 | 929 779 | 0,59 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.29800% 22-19.01.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 138 314 | 0,09 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 22-19.01.63* | USD | 430 000 | | 200 000 | 230 000 | 132 454 | 0,08 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 6.40000% 22-14.02.35* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 872 | 0,11 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 6.85300% 23-28.03.54* | USD | | 240 000 | | 240 000 | 195 308 | 0,12 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 6.87500% 23-31.01.36* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 175 468 | 0,11 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Davon ausgeliehen | | |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal |
| PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.375000% 18-04.10.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 163 | 0,11 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.100000% 14-11.08.44* | USD | 236 000 | | 236 000 | | | |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.700000% 17-27.03.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.600000% 18-13.03.48* | USD | 600 000 | 200 000 | 400 000 | 400 000 | 327 517 | 0,21 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.400000% 19-30.03.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 158 467 | 0,10 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.950000% 20-28.04.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 636 | 0,11 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 2.739000% 21-29.01.33* | USD | 400 000 | 210 000 | 200 000 | 410 000 | 298 892 | 0,19 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 3.849000% 22-28.06.33* | USD | 400 000 | | 200 000 | 200 000 | 157 341 | 0,10 |
| PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.850000% 23-21.08.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 180 534 | 0,11 |
| PELABUHAN INDONESIA PT-REG-S 4.875000% 14-01.10.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| PERTAMINA PERSERO PT-144A 2.300000% 21-09.02.31* | USD | 200 000 | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 298 676 | 0,19 |
| PERTAMINA PT-REG-S 6.000000% 12-03.05.42* | USD | 410 000 | | | 410 000 | 373 903 | 0,24 |
| PERU, REPUBLIC OF 2.844000% 19-20.06.30* | USD | 630 000 | | | 630 000 | 498 107 | 0,32 |
| PERU, REPUBLIC OF 3.230000% 20-28.07.21* | USD | 415 000 | 130 000 | 380 000 | 165 000 | 85 593 | 0,05 |
| PERU, REPUBLIC OF 3.300000% 21-11.03.41* | USD | 305 000 | 280 000 | 260 000 | 325 000 | 219 729 | 0,14 |
| PERU, REPUBLIC OF 3.550000% 21-10.03.51* | USD | 250 000 | 260 000 | 290 000 | 220 000 | 142 770 | 0,09 |
| PERU, REPUBLIC OF 3.000000% 21-15.01.34* | USD | 200 000 | 260 000 | 50 000 | 410 000 | 302 700 | 0,19 |
| PERU, REPUBLIC OF 3.600000% 21-15.01.72* | USD | 310 000 | | | 310 000 | 185 156 | 0,12 |
| PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.250000% 12-24.10.42* | USD | 270 000 | | 270 000 | | | |
| PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.250000% 18-25.01.49* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 182 442 | 0,12 |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.550000% 16-29.03.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 5.600000% 23-15.11.33* | USD | | 280 000 | 280 000 | | | |
| PERUSAHAAN SBSN INDONESIA III-REG-S 4.700000% 22-06.06.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 953 | 0,11 |
| PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.862000% 20-01.12.32* | USD | 635 000 | | 510 000 | 125 000 | 85 954 | 0,05 |
| PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.780000% 20-01.12.60* | USD | 547 000 | 350 000 | 430 000 | 467 000 | 242 781 | 0,15 |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 8.500000% 16-27.10.20* | USD | 150 000 | | 150 000 | | | |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 5.375000% 07-12.04.27* | USD | 53 000 | | 53 000 | | | |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 5.500000% 07-12.04.37* | USD | 73 000 | | 73 000 | | | |
| PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.750000% 17-19.06.32* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 281 244 | 0,18 |
| PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.625000% 17-19.06.47* | USD | 500 000 | 200 000 | 400 000 | 300 000 | 179 690 | 0,11 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.700000% 22-16.02.32* | USD | 1 036 000 | 100 000 | 420 000 | 716 000 | 536 880 | 0,34 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.500000% 11-02.06.41* | USD | 530 000 | | 100 000 | 430 000 | 263 074 | 0,17 |
| PETROLEOS MEXICANOS 5.500000% 12-27.06.44* | USD | 170 000 | | 170 000 | | | |
| PETROLEOS MEXICANOS 4.875000% 13-18.01.24* | USD | 260 000 | | 260 000 | | | |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.375000% 14-23.01.45* | USD | 100 000 | 175 000 | 137 000 | 138 000 | 80 265 | 0,05 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.500000% 18-13.03.27* | USD | | 70 000 | | 70 000 | 59 267 | 0,04 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.500000% 18-23.01.29* | USD | | 250 000 | 250 000 | | | |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.490000% 20-23.01.27* | USD | 310 000 | | 50 000 | 260 000 | 220 459 | 0,14 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.840000% 20-23.01.30* | USD | 110 000 | 100 000 | 210 000 | | | |
| PETROLEOS MEXICANOS 7.690000% 20-23.01.50* | USD | 460 000 | | | 460 000 | 297 699 | 0,19 |
| PETROLEOS MEXICANOS 5.950000% 20-28.01.31* | USD | 200 000 | 335 000 | 140 000 | 395 000 | 285 119 | 0,18 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.950000% 20-28.01.60* | USD | 808 000 | 100 000 | 860 000 | 48 000 | 28 580 | 0,02 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.500000% 05-02.02.30* | USD | 130 000 | | | 130 000 | 144 010 | 0,09 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.500000% 11-30.03.26* | USD | 750 000 | | 750 000 | | | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.000000% 18-01.02.28* | USD | 405 000 | | 200 000 | 205 000 | 172 158 | 0,11 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.457000% 20-05.05.30* | USD | 380 000 | 220 000 | | 600 000 | 468 966 | 0,30 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 1.648000% 20-10.06.31* | USD | 207 000 | 230 000 | 210 000 | 227 000 | 163 651 | 0,10 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.650000% 20-10.12.45* | USD | 635 000 | | 280 000 | 355 000 | 211 331 | 0,13 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE-REG-S 1.950000% 21-06.01.32* | USD | 460 000 | | | 260 000 | 188 465 | 0,12 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.200000% 21-06.07.46* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.609000% 22-13.04.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 187 020 | 0,12 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.500000% 23-17.01.48* | USD | 500 000 | 210 000 | 200 000 | 510 000 | 465 724 | 0,29 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.200000% 22-29.03.47* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| POLAND, REPUBLIC OF 3.250000% 16-06.04.26* | USD | 755 000 | | 300 000 | 455 000 | 398 495 | 0,25 |
| POLAND, REPUBLIC OF 4.625000% 24-18.03.29* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 178 432 | 0,11 |
| POLAND, REPUBLIC OF 5.125000% 24-18.09.34* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 403 418 | 0,26 |
| POLAND, REPUBLIC OF 5.500000% 24-18.03.54* | USD | | 304 000 | | 304 000 | 271 064 | 0,17 |
| POLAND, REPUBLIC OF 4.000000% 14-22.01.24* | USD | 597 000 | 110 000 | 707 000 | | | |
| POWER SECTOR ASST & LIAB MGT CORP-REG-S 7.390000% 09-02.12.24* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 182 282 | 0,12 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 9.750000% 00-15.06.30* | USD | 440 000 | | 440 000 | | | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 6.400000% 09-20.01.40* | USD | 220 000 | | 220 000 | | | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 5.750000% 11-20.01.42* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 384 486 | 0,24 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 4.500000% 18-23.04.28* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 270 379 | 0,17 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 5.103000% 18-23.04.48* | USD | 400 000 | 400 000 | 200 000 | 600 000 | 525 761 | 0,33 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 3.375000% 19-14.03.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 4.000000% 19-14.03.29* | USD | 400 000 | 200 000 | 300 000 | 300 000 | 264 468 | 0,17 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 4.817000% 19-14.03.49* | USD | 840 000 | 200 000 | 460 000 | 580 000 | 489 377 | 0,31 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 3.750000% 20-16.04.30* | USD | 630 000 | | | 630 000 | 545 027 | 0,34 |
| QATAR, STATE OF-REG-S 4.400000% 20-16.04.50* | USD | 1 215 000 | | 410 000 | 805 000 | 641 908 | 0,41 |
| QATARENERGY-REG-S 1.375000% 21-12.09.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| QATARENERGY-REG-S 2.250000% 21-12.07.31* | USD | 630 000 | 460 000 | 400 000 | 690 000 | 520 880 | 0,33 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal |
| QATARENERGY-REG-S 3.30000% 21-12.07.51* | USD | 1 015 000 | | 660 000 | 355 000 | 225 822 | 0,14 | |
| QATARENERGY-REG-S 3.12500% 21-12.07.41* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 235 239 | 0,15 | |
| REPUBLIC OF RWANDA-REG-S 5.50000% 21-09.08.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 146 307 | 0,09 | |
| REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTER BOND-REG-S 7.12500% 17-14.09.27* | USD | 290 000 | | | 290 000 | 238 763 | 0,15 | |
| REPUBLIC OF TURKEY 7.25000% 18-23.12.23* | USD | 220 000 | | 220 000 | | | | |
| REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.90000% 21-19.10.31* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 148 374 | 0,09 | |
| ROMANIA-REG-S 3.00000% 20-14.02.31* | USD | 1 020 000 | 340 000 | 250 000 | 1 110 000 | 840 438 | 0,53 | |
| ROMANIA-REG-S 3.00000% 22-27.02.27* | USD | 600 000 | 440 000 | 300 000 | 740 000 | 622 361 | 0,39 | |
| ROMANIA-REG-S 3.62500% 22-27.03.32* | USD | 310 000 | 120 000 | | 430 000 | 332 716 | 0,21 | |
| ROMANIA-REG-S 4.00000% 20-14.02.51* | USD | 636 000 | 190 000 | 390 000 | 436 000 | 278 479 | 0,18 | |
| ROMANIA-REG-S 5.12500% 18-15.06.48* | USD | 488 000 | 50 000 | 110 000 | 428 000 | 327 193 | 0,21 | |
| ROMANIA-REG-S 5.87500% 24-30.01.29* | USD | | 54 000 | | 54 000 | 48 668 | 0,03 | |
| ROMANIA-REG-S 6.37500% 24-30.01.34* | USD | | 244 000 | | 244 000 | 222 999 | 0,14 | |
| ROMANIA-REG-S 7.12500% 23-17.01.33* | USD | 320 000 | 200 000 | | 520 000 | 501 296 | 0,32 | |
| ROMANIA-REG-S 7.62500% 23-17.01.53* | USD | 440 000 | 40 000 | 170 000 | 310 000 | 309 931 | 0,20 | |
| ROMANIAN GOVNT INT BND-REG-S 5.25000% 22-25.11.27* | USD | 100 000 | 200 000 | | 300 000 | 266 410 | 0,17 | |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.37500% 19-16.04.29* | USD | 475 000 | | 200 000 | 275 000 | 242 893 | 0,15 | |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.50000% 22-25.10.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 186 726 | 0,12 | |
| SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48* | USD | 200 000 | 400 000 | 400 000 | 200 000 | 132 853 | 0,08 | |
| SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.12500% 20-01.12.30* | USD | 660 000 | | 440 000 | 220 000 | 156 975 | 0,10 | |
| SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 23-26.05.28* | USD | 220 000 | 210 000 | 230 000 | 200 000 | 183 799 | 0,12 | |
| SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 23-26.09.33* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 367 598 | 0,23 | |
| SINOCHEM OVERSEAS CAPITAL CO LTD-REG-S 6.30000% 10-12.11.40* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 98 238 | 0,06 | |
| SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 5.37500% 13-17.10.43* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 185 959 | 0,12 | |
| SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV LD-REG-S 3.75000% 18-12.09.23* | USD | | | 200 000 | | | | |
| SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 4.12500% 18-12.09.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 306 | 0,11 | |
| SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 4.25000% 18-12.09.28* | USD | 410 000 | | 410 000 | | | | |
| SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.95000% 19-08.08.29* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 332 517 | 0,21 | |
| SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30* | USD | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | 324 324 | 0,21 | |
| SINOPEC GUP OVERSEAS DEVPT-REG-S 2.30000% 21-08.01.31* | USD | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | 312 320 | 0,20 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 6.25000% 11-08.03.41* | USD | 140 000 | 320 000 | 240 000 | 220 000 | 163 477 | 0,10 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.66500% 12-17.01.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.37500% 14-24.07.44* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.87500% 16-14.04.26* | USD | 1 000 000 | | 400 000 | 600 000 | 525 558 | 0,33 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 17-27.09.27* | USD | 400 000 | | 200 000 | 200 000 | 171 133 | 0,11 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 261 653 | 0,17 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 19-30.09.29* | USD | 740 000 | 210 000 | 400 000 | 550 000 | 443 989 | 0,28 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.75000% 19-30.09.49* | USD | 900 000 | 400 000 | 680 000 | 620 000 | 405 563 | 0,26 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 22-20.04.32* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 324 702 | 0,21 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 7.30000% 22-20.04.52* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 195 058 | 0,12 | |
| SOVEREIGN WEALTH SAMRUK-KAZYNA-REG-S 2.00000% 21-28.10.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 164 738 | 0,10 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.12500% 15-03.06.25* | USD | 216 000 | | 216 000 | | | | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 18-18.04.23* | USD | 400 000 | 210 000 | | 610 000 | 316 135 | 0,20 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.82500% 16-18.07.26* | USD | 475 000 | | | 475 000 | 255 656 | 0,16 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.20000% 17-11.05.27* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 18-18.04.28* | USD | 210 000 | 330 000 | 210 000 | 330 000 | 175 325 | 0,11 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 19-14.03.24* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 315 530 | 0,20 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 7.85000% 19-14.03.29* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 78 882 | 0,05 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.35000% 19-28.06.24* | USD | 540 000 | | | 540 000 | 286 705 | 0,18 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 7.55000% 19-28.03.30* | USD | 600 000 | | 400 000 | 200 000 | 105 474 | 0,07 | |
| STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE-REG-S 6.25000% 21-24.06.30* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 51 610 | 0,03 | |
| STATE GRID OVERSEAS INV-REG-S 4.12500% 14-07.05.24* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 848 | 0,11 | |
| STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 2.87500% 16-18.05.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 344 864 | 0,22 | |
| SURINAME, REPUBLIC OF-144A 9.25000% 16-26.10.26* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| THREE GORGES FIN I CAYMAN ISLANDS-REG-S 3.70000% 15-10.06.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 894 | 0,11 | |
| TRANSNET SOC LTD-REG-S 8.25000% 23-06.02.28* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 179 408 | 0,11 | |
| TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 13-16.01.24* | USD | 420 000 | | 420 000 | | | | |
| TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-04.08.26* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | | |
| TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 20-26.06.30* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 337 087 | 0,21 | |
| TRINIDAD GENERATION UNLTD-REG-S 5.25000% 16-04.11.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 175 974 | 0,11 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 8.00000% 04-14.02.34* | USD | 185 000 | 80 000 | 185 000 | 80 000 | 75 208 | 0,05 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 7.37500% 05-05.02.25* | USD | 431 000 | | | 431 000 | 394 234 | 0,25 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36* | USD | | 60 000 | 60 000 | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 7.25000% 08-05.03.38* | USD | 190 000 | 60 000 | | 250 000 | 217 153 | 0,14 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.75000% 10-30.05.40* | USD | 570 000 | | 360 000 | 210 000 | 168 577 | 0,11 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41* | USD | 405 000 | | | 405 000 | 300 604 | 0,19 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43* | USD | 200 000 | 200 000 | 400 000 | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26* | USD | 842 000 | 200 000 | 400 000 | 642 000 | 560 902 | 0,35 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27* | USD | 660 000 | | | 200 000 | 409 272 | 0,26 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47* | USD | 555 000 | | 200 000 | 355 000 | 243 508 | 0,15 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.12500% 18-17.02.28* | USD | 215 000 | | 215 000 | | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 7.62500% 19-26.04.29* | USD | 770 000 | 250 000 | 1 020 000 | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.35000% 19-10.08.24* | USD | 500 000 | | 500 000 | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.60000% 19-14.11.24* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 0,14 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 20-13.03.25* | USD | 440 000 | | 200 000 | 240 000 | 0,13 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.25000% 20-13.03.30* | USD | 420 000 | 470 000 | 250 000 | 640 000 | 0,33 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.95000% 20-15.01.31* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 0,24 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.75000% 21-26.01.26* | USD | 430 000 | | | 430 000 | 0,24 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.50000% 21-20.09.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,11 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 9.87500% 22-15.01.28* | USD | | 270 000 | | 270 000 | 0,17 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 9.12500% 23-13.07.30* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 0,12 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 8.60000% 22-24.09.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,12 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-19.01.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,13 | |
| TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS-REG-S 9.37500% 23-31.01.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,12 | |
| UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 4.91700% 23-25.09.33* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | |
| UKRAINE RAILWAYS VIA RL CPTL MKTS-REG-S 8.25000% 19-09.07.24* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,07 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.25* | USD | 132 000 | | | 132 000 | 0,03 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.26* | USD | 230 000 | | | 230 000 | 0,05 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.27* | USD | 1 061 000 | 400 000 | 1 128 000 | 333 000 | 0,06 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.28* | USD | 528 000 | | | 528 000 | 0,10 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.29* | USD | 750 000 | | 560 000 | 190 000 | 0,04 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 17-25.09.34* | USD | 925 000 | | | 925 000 | 0,15 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 18-01.02.26* | USD | 390 000 | | | 390 000 | 0,08 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.30* | USD | 500 000 | 211 000 | 378 000 | 333 000 | 0,07 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.87600% 21-21.05.31* | USD | 425 000 | | | 425 000 | 0,07 | |
| UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 20-15.03.35* | USD | 880 000 | | 200 000 | 680 000 | 0,11 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45* | USD | 60 000 | | 60 000 | | | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.50000% 13-14.08.24* | USD | 145 000 | | 145 000 | | | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 15-27.10.27* | USD | 500 000 | | 200 000 | 300 000 | 0,17 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 5.75000% 22-28.10.34* | USD | 510 000 | | 240 000 | 270 000 | 0,16 | |
| UZBEKNEFTEGAZ JSC-REG-S 4.75000% 21-16.11.28* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 0,10 | |
| VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 6.80000% 10-22.11.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,00 | |
| VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 5.94200% 13-21.11.23* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 0,00 | |
| VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19* | USD | 127 000 | | 127 000 | | | |
| ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 14-14.04.24* | USD | 400 000 | | 200 000 | 200 000 | 0,08 | |
| ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.97000% 15-30.07.27* | USD | 385 000 | 200 000 | 200 000 | 385 000 | 0,16 | |
| TOTAL USD | | | | | 94 536 558 | 59,83 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | 94 536 558 | 59,83 | |

Notes, Nullcoupon

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|---------|---------|----------------|-------------|
| ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30* | USD | 294 841 | 140 000 | 140 000 | 294 841 | 130 923 | 0,08 |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 0.00000% 21-07.04.25* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 130 923 | 0,08 |
| Total Notes, Nullcoupon | | | | | | 130 923 | 0,08 |

Notes, variabler Zins

USD

| | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|----------------|-------------|
| BANCO NACIONAL DE COM-REG-S-SUB 2.720%/VAR 21-11.08.31* | USD | 240 000 | | | 240 000 | 192 795 | 0,12 |
| CLI OVERSEAS CO LTD/HK-REG-S-SUB 5.350%/VAR 23-15.08.33* | USD | | 440 000 | 230 000 | 210 000 | 190 598 | 0,12 |
| TOTAL USD | | | | | | 383 393 | 0,24 |
| Total Notes, variabler Zins | | | | | | 383 393 | 0,24 |

Medium-Term Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|---------|---------|---------|------|
| ABU DHABI GOVERNMENT INTL-REG-S 1.87500% 21-15.09.31* | USD | 400 000 | 510 000 | 200 000 | 710 000 | 531 748 | 0,34 |
| ABU DHABI GOVERNMENT INTERNAT-REG-S 3.00000% 21-15.09.51* | USD | 335 000 | | | 335 000 | 205 462 | 0,13 |
| ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 2.50000% 20-16.04.25* | USD | 705 000 | | | 705 000 | 617 861 | 0,39 |
| ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30* | USD | 715 000 | | 430 000 | 285 000 | 236 324 | 0,15 |
| ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 2.70000% 20-02.09.70* | USD | 280 000 | 410 000 | 200 000 | 490 000 | 259 979 | 0,16 |
| ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.00000% 19-26.11.29* | USD | 865 000 | | 400 000 | 465 000 | 390 424 | 0,25 |
| ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.12500% 19-26.11.49* | USD | 210 000 | 200 000 | 200 000 | 210 000 | 160 243 | 0,10 |
| ARAB REPUBLIC OF EGYPT-REG-S 5.87500% 21-16.02.31* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 288 224 | 0,18 |
| BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.25000% 21-25.01.33* | USD | 200 000 | 670 000 | 577 000 | 293 000 | 234 628 | 0,15 |
| BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 21-18.05.34* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 162 520 | 0,10 |
| BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 21-25.01.28* | USD | 225 000 | | | 225 000 | 189 041 | 0,12 |

| Titel | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|---------------------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|---------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | | | Anzahl/ Nominal | | | | |
| BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 6.25000% 21-25.01.51* | USD | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO-REG-S 5.37500% 23-22.05.33* | USD | 600 000 | 200 000 | 400 000 | | 358 479 | 0,23 | |
| CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 3.37500% 17-24.01.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 174 244 | 0,11 | |
| CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 1.62500% 20-27.10.30* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| CHINA DEVELOPMENT BANK/HONG KONG-REG-S 0.62500% 21-09.09.24* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 264 371 | 0,17 | |
| DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.74950% 19-30.01.30* | USD | 480 000 | | 480 000 | | 401 262 | 0,25 | |
| DP WORLD PLC-REG-S 5.62500% 18-25.09.48* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 343 487 | 0,22 | |
| DUBAI DOF SUKUK LTD-REG-S 2.76300% 20-09.09.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.90000% 20-09.09.50* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 15-11.06.25* | USD | 800 000 | | 400 000 | 400 000 | 354 876 | 0,22 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47* | USD | 740 000 | | 740 000 | | 529 049 | 0,33 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27* | USD | 490 000 | 200 000 | 400 000 | 290 000 | 251 571 | 0,16 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.20040% 19-01.03.24* | USD | 210 000 | 200 000 | 410 000 | | | | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.60030% 19-01.03.29* | USD | 660 000 | | 430 000 | 230 000 | 191 236 | 0,12 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.70020% 19-01.03.49* | USD | 300 000 | 200 000 | 200 000 | 300 000 | 218 617 | 0,14 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.05290% 19-15.01.32* | USD | 340 000 | | 340 000 | | 253 699 | 0,16 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 3.87500% 21-16.02.26* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 331 007 | 0,21 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 21-16.02.61* | USD | 600 000 | 270 000 | 400 000 | 470 000 | 303 739 | 0,19 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.80000% 21-30.09.27* | USD | | 200 000 | 200 000 | | 162 576 | 0,10 | |
| EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.30000% 21-30.09.33* | USD | 400 000 | | 380 000 | 320 000 | 236 164 | 0,15 | |
| EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 8.45000% 18-10.08.28* | USD | 220 000 | | 220 000 | | 197 163 | 0,12 | |
| EXIMCH/ AVI FUNDING CO LTD-REG-S 3.80000% 15-16.09.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 352 314 | 0,22 | |
| EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA-REG-S 4.00000% 17-28.11.47* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA-REG-S 3.25000% 17-28.11.27* | USD | | 240 000 | 240 000 | | 206 244 | 0,13 | |
| FINANCE DEPTMENT GOVT OF SHARIAH-REG-S 4.00000% 20-28.07.50* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| FINANCE DEPTMENT GOVT OF SHARIAH-REG-S 3.62500% 21-10.03.33* | USD | 200 000 | 200 000 | 400 000 | | 303 986 | 0,19 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.12500% 15-15.01.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 14-15.01.44* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 15-08.01.26* | USD | 400 000 | 210 000 | 610 000 | | 547 790 | 0,35 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.95000% 15-08.01.46* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 194 423 | 0,12 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.85000% 17-18.07.27* | USD | 310 000 | | 310 000 | | 269 852 | 0,17 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 169 386 | 0,11 | |
| KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-21.07.25* | USD | 1 150 000 | | 1 150 000 | | | | |
| KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 403 982 | 0,26 | |
| KHAZHANAH CAPITAL LTD-REG-S 4.87600% 23-01.06.33* | USD | | 720 000 | 455 000 | 265 000 | 235 072 | 0,15 | |
| KINGDOM OF SAUDI ARABIA-REG-S 2.25000% 21-02.02.33* | USD | 220 000 | 400 000 | 620 000 | | 450 412 | 0,29 | |
| KSA SUKUK LTD-REG-S 3.62800% 17-20.04.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 174 173 | 0,11 | |
| KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29* | USD | 730 000 | | 730 000 | | | | |
| KSA SUKUK LTD-REG-S 2.96900% 19-29.10.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 163 590 | 0,10 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 06-12.04.21* | USD | 450 000 | | 450 000 | | 26 548 | 0,02 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.10000% 10-04.10.22* | USD | 350 000 | | 350 000 | | 20 649 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.60000% 11-27.11.26* | USD | 586 000 | | 586 000 | | 34 572 | 0,02 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.25000% 15-04.11.24* | USD | 745 000 | | 430 000 | 315 000 | 18 584 | 0,01 | |
| MDGH - GMTN BV-REG-S 3.75000% 17-19.04.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 19-07.11.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 20-21.05.26* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 169 951 | 0,11 | |
| MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | 160 719 | 0,10 | |
| MDGH - GMTN BV-REG-S 3.37500% 22-28.03.32* | USD | | 400 000 | 200 000 | 200 000 | 162 158 | 0,10 | |
| MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 6.87500% 11-01.11.41* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 420 177 | 0,27 | |
| MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 3.40000% 21-07.06.51* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 6.75000% 04-27.09.34* | USD | 380 000 | 200 000 | 280 000 | 300 000 | 288 871 | 0,18 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44* | USD | 484 000 | 260 000 | 640 000 | 104 000 | 78 334 | 0,05 | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 5.55000% 14-21.01.45* | USD | 340 000 | | 340 000 | | | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 4.12500% 16-21.01.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 21-19.04.71* | USD | 460 000 | | 460 000 | | 264 519 | 0,17 | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 17-28.11.27* | USD | 600 000 | 320 000 | 920 000 | | | | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 17-28.11.47* | USD | 805 000 | | 320 000 | 485 000 | 339 779 | 0,22 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 21-28.09.28* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 326 053 | 0,21 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-28.09.33* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 308 377 | 0,20 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 21-28.09.51* | USD | 350 000 | | 350 000 | | 258 205 | 0,16 | |
| NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.37500% 22-24.03.29* | USD | 400 000 | 230 000 | 420 000 | 210 000 | 184 477 | 0,12 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.87500% 19-01.02.25* | USD | 455 000 | | 200 000 | 255 000 | 227 382 | 0,14 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 19-01.08.29* | USD | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | 368 274 | 0,23 | |
| OQ SAOC-REG-S 5.12500% 21-06.05.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 176 368 | 0,11 | |
| PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 21-08.04.26* | USD | 780 000 | 650 000 | 720 000 | 710 000 | 568 033 | 0,36 | |
| PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31* | USD | 570 000 | 200 000 | 480 000 | 290 000 | 204 420 | 0,13 | |
| PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 21-08.04.51* | USD | 200 000 | 200 000 | 400 000 | | | | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|---|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 9.37500% 99-01.04.29* | USD | 225 000 | | 225 000 | | | |
| PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 3.65000% 19-30.07.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 518 | 0,11 |
| PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44* | USD | 205 000 | | 205 000 | | | |
| PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.45000% 18-21.05.28* | USD | 240 000 | | 240 000 | | | |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.90000% 19-20.08.24* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.45000% 19-20.02.29* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | |
| PERUSAHAAN PERS PT PERU LIST NEG-REG-S 3.00000% 20-30.06.30* | USD | 200 000 | 480 000 | | 680 000 | 534 306 | 0,34 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.62500% 05-15.06.35* | USD | 370 000 | 110 000 | 370 000 | 110 000 | 75 199 | 0,05 |
| PETROLEOS MEXICANOS 4.50000% 16-23.01.26* | USD | 905 000 | | 485 000 | 420 000 | 355 242 | 0,22 |
| PETROLEOS MEXICANOS 5.62500% 16-23.01.46* | USD | | 400 000 | 225 000 | 175 000 | 94 672 | 0,06 |
| PETROLEOS MEXICANOS 6.75000% 17-21.09.47* | USD | 194 000 | 90 000 | | 284 000 | 169 083 | 0,11 |
| PETROLEOS MEXICANOS 8.75000% 22-02.06.29* | USD | 300 000 | | 150 000 | 150 000 | 131 770 | 0,08 |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.50000% 15-18.03.45* | USD | 400 000 | | 200 000 | 200 000 | 159 199 | 0,10 |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 20-21.04.30* | USD | 600 000 | 400 000 | 490 000 | 510 000 | 421 478 | 0,27 |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.55000% 20-21.04.50* | USD | 1 470 000 | 200 000 | 650 000 | 1 020 000 | 810 094 | 0,51 |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.80000% 20-21.04.60* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 162 773 | 0,10 |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.40400% 21-28.04.61* | USD | 600 000 | 200 000 | 400 000 | 400 000 | 246 799 | 0,16 |
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 2.48000% 21-28.01.32* | USD | 500 000 | | 500 000 | | | |
| PETRONAS ENERGY CANADA LTD-REG-S 2.11200% 21-23.03.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 161 532 | 0,10 |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.62500% 00-16.03.25* | USD | 150 000 | | 100 000 | 50 000 | 47 225 | 0,03 |
| POLAND, REPUBLIC OF 5.50000% 22-16.11.27* | USD | 500 000 | | 150 000 | 350 000 | 322 918 | 0,20 |
| POLAND, REPUBLIC OF 5.75000% 22-16.11.32* | USD | 560 000 | 500 000 | 530 000 | 530 000 | 499 764 | 0,32 |
| REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 5.37500% 19-20.02.29* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 169 512 | 0,11 |
| REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 4.75000% 19-20.02.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.70000% 20-25.11.30* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | |
| REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 7.85000% 23-12.10.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 188 623 | 0,12 |
| ROMANIA -REG-S 6.00000% 22-25.05.34* | USD | 590 000 | 110 000 | 590 000 | 110 000 | 98 458 | 0,06 |
| ROMANIA-REG-S 4.87500% 14-22.01.24* | USD | 248 000 | | 248 000 | | | |
| ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44* | USD | 330 000 | 280 000 | 410 000 | 200 000 | 175 580 | 0,11 |
| RONGSHI INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 3.75000% 19-21.05.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.25000% 16-26.10.26* | USD | 765 000 | | 210 000 | 555 000 | 479 424 | 0,30 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 16-26.10.46* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 461 890 | 0,29 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.62500% 17-04.03.28* | USD | 600 000 | | 310 000 | 290 000 | 250 265 | 0,16 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 17-04.10.47* | USD | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | 310 854 | 0,20 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.00000% 18-17.04.25* | USD | 715 000 | | 415 000 | 300 000 | 266 579 | 0,17 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 18-17.04.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 353 187 | 0,22 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49* | USD | 690 000 | 200 000 | 311 000 | 579 000 | 475 222 | 0,30 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.50000% 20-03.02.27* | USD | 500 000 | 280 000 | | 780 000 | 658 417 | 0,42 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.75000% 20-03.02.32* | USD | 580 000 | | | 580 000 | 449 432 | 0,28 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.75000% 20-21.01.55* | USD | 620 000 | | 200 000 | 420 000 | 273 436 | 0,17 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.90000% 20-22.10.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 173 | 0,11 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.25000% 20-22.10.30* | USD | 340 000 | 280 000 | | 620 000 | 507 477 | 0,32 |
| SAUDI GOVERNMENT INTER-REG-S 4.50000% 20-22.04.60* | USD | 200 000 | 300 000 | 200 000 | 300 000 | 222 585 | 0,14 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.45000% 21-02.02.61* | USD | 280 000 | 270 000 | | 320 000 | 192 029 | 0,12 |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.25000% 21-17.11.51* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.87500% 23-18.07.33* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 5.00000% 23-18.01.53* | USD | | 240 000 | 240 000 | | | |
| SHARIAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 4.22600% 18-14.03.28* | USD | 600 000 | | 400 000 | 200 000 | 172 991 | 0,11 |
| SHARIAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.85400% 19-03.04.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 271 | 0,11 |
| SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD-REG-S 2.37500% 21-23.09.31* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.50000% 17-04.05.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 442 | 0,11 |
| STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 3.75000% 18-02.05.23* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 4.25000% 18-02.05.28* | USD | 205 000 | | 205 000 | | | |
| STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 1.62500% 20-05.08.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-29.09.23* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 9.50000% 23-01.08.26* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 190 160 | 0,12 |
| TURKEY, REPUBLIC OF 11.87500% 00-15.01.30* | USD | 313 000 | | 313 000 | | | |
| UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 3.25000% 21-19.10.61* | USD | 260 000 | 200 000 | | 460 000 | 285 623 | 0,18 |
| UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.05000% 22-07.07.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 328 | 0,11 |
| TOTAL USD | | | | | | 27 162 197 | 17,19 |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 27 162 197 | 17,19 |

Anleihen, fester Zins

USD

| | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|---------|------|
| ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| ABU DHABI GOVERNMENT OF-REG-S 2.12500% 19-30.09.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| ABU DHABI GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 19-30.09.49* | USD | 755 000 | 310 000 | 710 000 | 355 000 | 224 923 | 0,14 |
| ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.50000% 15-12.11.25* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 321 057 | 0,20 |

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | | | |
| ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28* | USD | 600 000 | 400 000 | 600 000 | 400 000 | | 347 107 | 0,22 | |
| ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.41* | USD | 731 000 | 150 000 | 200 000 | 681 000 | | 246 577 | 0,16 | |
| ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.15000% 15-26.03.25* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 14-19.09.44* | USD | 250 000 | 200 000 | 450 000 | | | | | |
| BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | | | |
| BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47* | USD | 650 000 | | 200 000 | 450 000 | | 388 216 | 0,25 | |
| BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.62500% 19-30.09.31* | USD | 600 000 | 200 000 | 300 000 | 500 000 | | 424 455 | 0,27 | |
| BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 20-14.05.30* | USD | 850 000 | 200 000 | 200 000 | 850 000 | | 795 980 | 0,50 | |
| BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.45000% 20-16.09.32* | USD | 200 000 | 240 000 | 440 000 | | | 362 993 | 0,23 | |
| BARBADOS GOV INTER BOND-REG-S 6.50000% 19-01.10.29* | USD | 180 000 | 70 000 | 50 000 | 200 000 | | 170 795 | 0,11 | |
| BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34* | USD | 440 000 | | 440 000 | | | | | |
| BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37* | USD | 131 000 | | 131 000 | | | | | |
| BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45* | USD | 400 000 | 400 000 | 500 000 | 300 000 | | 215 343 | 0,14 | |
| BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26* | USD | 720 000 | | 510 000 | 210 000 | | 191 606 | 0,12 | |
| BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | 308 580 | 0,20 | |
| BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.50000% 19-30.05.29* | USD | 805 000 | | 570 000 | 235 000 | | 201 716 | 0,13 | |
| CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.75000% 15-30.01.25* | USD | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | | 339 451 | 0,21 | |
| CHINA HUANENG GROUP HONG KONG MGT-REG-S 2.70000% 21-20.01.31* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 157 332 | 0,10 | |
| CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 2.62500% 17-02.11.27* | USD | 400 000 | | 400 000 | 400 000 | | 339 647 | 0,21 | |
| CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 2.12500% 21-03.06.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 168 141 | 0,11 | |
| CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.12500% 17-19.07.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 173 572 | 0,11 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.12500% 04-21.05.24* | USD | 186 000 | | 186 000 | | | | | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.37500% 06-18.09.37* | USD | 505 000 | 110 000 | 615 000 | | | | | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41* | USD | 1 155 000 | 720 000 | 1 020 000 | 855 000 | | 664 210 | 0,42 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.00000% 13-26.02.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44* | USD | 600 000 | | 280 000 | 320 000 | | 228 706 | 0,14 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.00000% 15-15.06.45* | USD | 540 000 | | 220 000 | 320 000 | | 208 530 | 0,13 | |
| COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 15-28.01.26* | USD | 600 000 | | 230 000 | 370 000 | | 325 094 | 0,21 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 05-21.09.35* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.15000% 06-24.10.36* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 13-18.10.43* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.30000% 23-13.11.54* | USD | | 520 000 | | 520 000 | | 497 783 | 0,32 | |
| CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 13-26.01.24* | USD | 605 000 | | 605 000 | | | | | |
| DAE SUKUK DIFC LTD-REG-S 3.75000% 20-15.02.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 174 173 | 0,11 | |
| DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 22-22.02.33* | USD | 750 000 | 150 000 | 401 000 | 499 000 | | 437 230 | 0,28 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.45000% 14-30.04.44* | USD | 255 000 | 100 000 | 180 000 | 175 000 | | 165 947 | 0,11 | |
| DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 22-22.02.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 174 376 | 0,11 | |
| EDO SUKUK LTD-REG-S 5.87500% 23-21.09.33* | USD | | 250 000 | | 250 000 | | 229 467 | 0,15 | |
| EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 10.87500% 23-28.02.26* | USD | 240 000 | | 240 000 | 240 000 | | 225 625 | 0,14 | |
| EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.65000% 05-15.06.35* | USD | 346 000 | 310 000 | 530 000 | 126 000 | | 86 421 | 0,05 | |
| ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 4.31400% 21-23.07.27* | USD | 415 000 | | 200 000 | 215 000 | | 178 098 | 0,11 | |
| ETHIOPIA INTERNATI BD-REG-S *DEFAULTED* 6.62500% 14-11.12.24* | USD | 400 000 | | 400 000 | 400 000 | | 262 860 | 0,17 | |
| EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 8.25000% 19-24.01.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.95000% 15-16.06.25* | USD | 350 000 | | | 350 000 | | 308 743 | 0,20 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 14-18.01.26* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | | 95 080 | 0,06 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30* | USD | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 200 000 | | 122 664 | 0,08 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 19-26.03.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 93 279 | 0,06 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 19-26.03.32* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.95000% 19-26.03.51* | USD | 500 000 | | 200 000 | 300 000 | | 137 976 | 0,09 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 20-11.02.35* | USD | 660 000 | | 340 000 | 320 000 | | 148 075 | 0,09 | |
| GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.75000% 20-11.03.61* | USD | 300 000 | | 300 000 | 300 000 | | 137 976 | 0,09 | |
| ICD FUNDING LTD-REG-S 3.22300% 20-28.04.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 200 000 | | 171 519 | 0,11 | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35* | USD | 120 000 | | 120 000 | | | | | |
| IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28* | USD | 750 000 | 850 000 | 750 000 | 850 000 | | 361 146 | 0,23 | |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 15-03.03.28* | USD | 400 000 | 200 000 | 400 000 | 200 000 | | 177 776 | 0,11 | |
| IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33* | USD | 400 000 | | 400 000 | 400 000 | | 323 802 | 0,20 | |
| JAMAICA, GOVERNMENT OF 8.00000% 07-15.03.39* | USD | 709 000 | 101 000 | 430 000 | 380 000 | | 406 227 | 0,26 | |
| JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 17-10.10.47* | USD | 275 000 | | 275 000 | 275 000 | | 218 666 | 0,14 | |
| KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 14-14.10.44* | USD | 600 000 | 200 000 | 200 000 | 600 000 | | 514 977 | 0,33 | |
| KING POWER CAPITAL LTD-REG-S 5.62500% 14-03.11.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 12-29.11.27* | USD | 120 000 | | | 120 000 | | 7 080 | 0,00 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 12-27.01.23* | USD | 155 000 | | | 155 000 | | 9 144 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.20000% 15-26.02.25* | USD | 347 000 | | | 347 000 | | 20 472 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.05000% 15-02.11.35* | USD | 66 000 | | | 66 000 | | 3 894 | 0,00 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-03.11.28* | USD | 211 000 | | | 211 000 | | 12 448 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 16-22.04.24* | USD | 355 000 | | | 355 000 | | 20 944 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 17-23.03.27* | USD | 1 157 000 | | 950 000 | 207 000 | | 12 212 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-23.03.37* | USD | 250 000 | | | 250 000 | | 14 749 | 0,01 | |
| LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-23.03.32* | USD | 260 000 | | | 260 000 | | 15 339 | 0,01 | |
| MALAYSIA SUKUK GLOBAL BHD-REG-S 3.17900% 16-27.04.26* | USD | 500 000 | | 250 000 | 250 000 | | 217 859 | 0,14 | |
| MALAYSIA SUKUK GLOBAL BHD-REG-S 4.08000% 16-27.04.46* | USD | 500 000 | | 250 000 | 250 000 | | 201 793 | 0,13 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 2.07000% 21-28.04.31* | USD | 450 000 | 250 000 | 250 000 | 450 000 | 345 466 | 0,22 | |
| MAZOOON ASSETS CO SAOC-REG-S 5.20000% 17-08.11.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 178 057 | 0,11 | |
| MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 152 162 | 0,10 | |
| MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MINMETALS BOUNTEOUS FIN BVI LTD-REG-S 4.20000% 16-27.07.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 20-07.04.26* | USD | | 220 000 | | 220 000 | 192 372 | 0,12 | |
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 316 934 | 0,20 | |
| MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO-REG-S 5.62500% 19-27.02.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO-REG-S 4.10000% 20-21.01.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 20-28.10.27* | USD | 630 000 | | 400 000 | 230 000 | 215 512 | 0,14 | |
| OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.37500% 20-28.10.32* | USD | 450 000 | | 200 000 | 250 000 | 250 226 | 0,16 | |
| OMAN SOVEREIGN SUKUK CO-REG-S 4.87500% 21-15.06.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 354 988 | 0,22 | |
| PAKISTAN GLOBAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 7.95000% 22-31.01.29* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 155 391 | 0,10 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27* | USD | 69 000 | | | 69 000 | 67 081 | 0,04 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26* | USD | 391 000 | | 100 000 | 291 000 | 265 871 | 0,17 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36* | USD | 463 000 | 300 000 | 763 000 | | | | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53* | USD | 1 050 000 | | 767 000 | 283 000 | 164 489 | 0,10 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25* | USD | 220 000 | | 220 000 | | | | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 3.87500% 16-17.03.28* | USD | 410 000 | | | 410 000 | 336 513 | 0,21 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50* | USD | 600 000 | | 230 000 | 370 000 | 223 908 | 0,14 | |
| PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 5.37500% 15-05.05.45* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 172 877 | 0,11 | |
| PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26* | USD | 180 000 | 150 000 | 100 000 | 230 000 | 196 285 | 0,12 | |
| PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31* | USD | 600 000 | | 420 000 | 180 000 | 139 276 | 0,09 | |
| PERU, REPUBLIC OF 4.12500% 15-25.08.27* | USD | 255 000 | 50 000 | 50 000 | 255 000 | 222 573 | 0,14 | |
| PERU, REPUBLIC OF 6.55000% 07-14.03.37* | USD | 616 000 | 200 000 | 260 000 | 556 000 | 544 139 | 0,34 | |
| PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25* | USD | 360 000 | | 360 000 | | | | |
| PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33* | USD | 389 000 | 60 000 | 320 000 | 129 000 | 143 531 | 0,09 | |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 2.55000% 21-09.06.31* | USD | 320 000 | 200 000 | 200 000 | 320 000 | 247 239 | 0,16 | |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35* | USD | 159 000 | | 159 000 | | | | |
| PETROLEOS DE VENEZUELA-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24* | USD | 506 000 | | 506 000 | | | | |
| PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.62500% 10-PRP* | USD | 100 000 | 470 000 | 200 000 | 370 000 | 201 205 | 0,13 | |
| PETROLIAM NASIONAL BERHAD-REG-S 7.62500% 96-15.10.26* | USD | 335 000 | | | 335 000 | 319 383 | 0,20 | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31* | USD | 220 000 | | 120 000 | 100 000 | 104 370 | 0,07 | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 07-15.01.32* | USD | 210 000 | | | 210 000 | 204 977 | 0,13 | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34* | USD | 615 000 | | 410 000 | 205 000 | 203 961 | 0,13 | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40* | USD | | 230 000 | | 230 000 | 178 272 | 0,11 | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 16-01.03.41* | USD | 240 000 | | 240 000 | | | | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.70000% 17-02.02.42* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 443 150 | 0,28 | |
| PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.75000% 19-14.01.29* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| POLAND, REPUBLIC OF 4.87500% 23-04.10.33* | USD | 75 000 | 1 245 000 | 280 000 | 1 040 000 | 921 787 | 0,58 | |
| POLAND, REPUBLIC OF 5.50000% 23-04.04.53* | USD | 75 000 | 1 110 000 | 290 000 | 895 000 | 805 893 | 0,51 | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 4.62500% 16-02.06.46* | USD | 750 000 | 200 000 | 640 000 | 310 000 | 257 019 | 0,16 | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26* | USD | 1 085 000 | 200 000 | 500 000 | 785 000 | 684 733 | 0,43 | |
| RAK CAPITAL-REG-S 3.09400% 15-31.03.25* | USD | 550 000 | | 550 000 | | | | |
| REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32* | USD | 625 000 | 200 000 | 470 000 | 355 000 | 271 147 | 0,17 | |
| ROMANIA-REG-S 4.37500% 13-22.08.23* | USD | 440 000 | | 440 000 | | | | |
| RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.25000% 17-23.06.47* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 0 | 0,00 | |
| SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50* | USD | 545 000 | 400 000 | 945 000 | | | | |
| SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33* | USD | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | 307 364 | 0,19 | |
| SHARIAH SUKUK LTD-REG-S 3.76400% 14-17.09.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| SHARIAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 2.94200% 20-10.06.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 136 | 0,11 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28* | USD | | 250 000 | 250 000 | | | | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46* | USD | 600 000 | | 400 000 | 200 000 | 120 964 | 0,08 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30* | USD | 550 000 | 420 000 | 200 000 | 770 000 | 639 790 | 0,40 | |
| SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 6.30000% 18-22.06.48* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26* | USD | 800 000 | 210 000 | 600 000 | 410 000 | 373 357 | 0,24 | |
| SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 15-03.11.25* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30* | USD | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 200 000 | 185 020 | 0,12 | |
| SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP-REG-S 2.95000% 22-01.03.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 780 | 0,11 | |
| THREE GORGES FIN I CAYMAN ISLANDS-REG-S 2.15000% 20-22.09.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.62500% 14-17.02.45* | USD | 300 000 | 320 000 | 233 000 | 387 000 | 299 691 | 0,19 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26* | USD | 630 000 | | 210 000 | 420 000 | 364 581 | 0,23 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28* | USD | 200 000 | 320 000 | 520 000 | | | | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 6.37500% 20-14.10.25* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 362 081 | 0,23 | |
| TURKEY, REPUBLIC OF 5.87500% 21-26.06.31* | USD | 420 000 | 200 000 | 200 000 | 420 000 | 347 203 | 0,22 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36* | USD | 780 000 | 200 000 | 530 000 | 450 000 | 490 051 | 0,31 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50* | USD | 1 840 000 | 420 000 | 941 000 | 1 319 000 | 1 149 041 | 0,73 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55* | USD | 711 687 | 270 000 | 480 000 | 501 687 | 424 051 | 0,27 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 19-23.01.31* | USD | 691 000 | | 130 000 | 561 000 | 494 713 | 0,31 | |
| VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 03-01.12.18* | USD | 50 000 | | 50 000 | | | | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 05-09.12.20* | USD | 141 000 | | 141 000 | | | | |
| VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 07-31.03.38* | USD | 167 000 | | 167 000 | | | | |
| VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24* | USD | 475 000 | 200 000 | 400 000 | 275 000 | 245 711 | 0,16 | |
| ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 12-20.09.22* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 117 639 | 0,07 | |
| TOTAL USD | | | | | | 28 728 811 | 18,18 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 28 728 811 | 18,18 | |

Anleihen, variabler Zins

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|----------------|-------------|--|
| CHINA HUADIAN OVERSEAS DEV 2018 LTD-REG-S 3.375%/VAR 20-PRP* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| POWERCHINA ROADBRIDGE GRP BRITISH-REG-S 3.080%/VAR 21-PRP* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 171 133 | 0,11 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33* | USD | 200 000 | 200 000 | 80 000 | 320 000 | 345 058 | 0,22 | |
| TOTAL USD | | | | | | 516 191 | 0,33 | |
| Total Anleihen, variabler Zins | | | | | | 516 191 | 0,33 | |

Treasury-Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|--|-----------|-----------|--|--------------------|--------------|--|
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 22-29.02.24* | USD | | 1 117 000 | 1 117 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | | 0,00 | |
| Total Treasury-Notes, fester Zins | | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 151 458 073 | 95,85 | |

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|----------------|-------------|--|
| BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 70 975 | 0,04 | |
| PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50* | USD | 671 000 | | 230 000 | 441 000 | 394 230 | 0,25 | |
| PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 13-15.11.26* | USD | 668 000 | | 668 000 | | | | |
| SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S 9.00000% 23-31.12.50* | USD | | 137 000 | 137 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 465 205 | 0,29 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 465 205 | 0,29 | |

Medium-Term Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 15-18.03.25* | USD | 405 000 | | | 405 000 | 357 856 | 0,23 | |
| TOTAL USD | | | | | | 357 856 | 0,23 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 357 856 | 0,23 | |

Anleihen, fester Zins

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|------------------|-------------|--|
| MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 162 095 | 0,10 | |
| PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21* | USD | 180 000 | | 180 000 | | | | |
| SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S (PIK) 7.95000% 23-15.07.33* | USD | | 285 538 | 100 000 | 185 538 | 153 014 | 0,10 | |
| TOTAL USD | | | | | | 315 109 | 0,20 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 315 109 | 0,20 | |
| Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 1 138 170 | 0,72 | |

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

Notes, fester Zins

USD

| | | | | | | | | |
|---|-----|--|---------|---------|--|--|-------------|--|
| PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 23-19.06.32** | USD | | 400 000 | 400 000 | | | | |
| PETROLEOS DEL PERU SA 5.62500% 17-19.06.47** | USD | | 500 000 | 500 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | | 0,00 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | | 0,00 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Nicht-Effekten | | | | | | | |
| Treasury-Bills, Nullcoupon | | | | | | | |
| USD | | | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.01.23-02.05.23** | USD | 2 100 000 | | 2 100 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 01.12.22-30.11.23** | USD | | 1 600 000 | 1 600 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 03.08.23-01.02.24** | USD | | 1 810 000 | 1 810 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 09.05.23-05.09.23** | USD | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 06.06.23-03.10.23** | USD | | 2 000 000 | 2 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 05.09.23-02.01.24** | USD | | 3 800 000 | 3 800 000 | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 0,00 | |
| Total Treasury-Bills, Nullcoupon | | | | | | 0,00 | |
| Total Nicht-Effekten | | | | | | 0,00 | |
| Total Wertschriften | | | | | 152 596 243 | 96,57 | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | 0,00 | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | 7 097 957 | 4,49 | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | -3 919 319 | -2,48 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 2 236 079 | 1,42 | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | 158 010 960 | 100,00 | |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | -1 947 093 | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | -231 | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | 156 063 636 | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 152 596 243 | 96,57 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | -3 919 319 | -2,48 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 148 676 924 | 94,09 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|----------------------------------|-----------------------|
| Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| USD | 171 888 956 | CHF | 150 880 000 | 02.04.2024 | -3 940 382 | -2.49 |
| USD | 1 472 597 | CHF | 1 300 000 | 02.04.2024 | -26 368 | -0.02 |
| CHF | 575 000 | USD | 652 612 | 02.04.2024 | 12 808 | 0.01 |
| USD | 1 018 915 | CHF | 900 000 | 02.04.2024 | -17 737 | -0.01 |
| CHF | 152 505 000 | USD | 168 364 981 | 02.04.2024 | -858 661 | -0.54 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|----------------------------------|-----------------------|
| CHF | 130 000 | USD | 144 087 | 02.04.2024 | -220 | 0.00 |
| USD | 172 205 415 | CHF | 155 450 000 | 03.05.2024 | 910 993 | 0.57 |
| USD | 144 584 | CHF | 130 000 | 03.05.2024 | 248 | 0.00 |
| | | | | | -3 919 319 | -2.48 |

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.23 | USD | 2 | 0 |
| US LONG BOND FUTURE 21.06.23 | USD | 9 | 0 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23 | USD | 7 | 7 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.23 | USD | 7 | 7 |
| US LONG BOND FUTURE 19.12.23 | USD | 6 | 6 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23 | USD | 7 | 7 |
| US LONG BOND FUTURE 19.03.24 | USD | 6 | 6 |

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.23 | USD | 2 | 5 |
| US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23 | USD | 0 | 7 |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.09.23 | USD | 2 | 2 |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23 | USD | 2 | 2 |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.23 | USD | 7 | 7 |
| US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24 | USD | 2 | 2 |
| US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24 | USD | 7 | 7 |
| US LONG BOND FUTURE 19.03.24 | USD | 14 | 14 |

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|-------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| Devisentermingeschäfte | | | | |
| CHF | 85 000 | USD | 93 870 | 11.04.2023 |
| USD | 94 090 | CHF | 85 000 | 02.05.2023 |
| CHF | 180 000 | USD | 203 244 | 02.05.2023 |
| USD | 230 148 449 | CHF | 204 135 000 | 02.06.2023 |
| USD | 313 082 | CHF | 280 000 | 02.06.2023 |
| USD | 223 446 663 | CHF | 203 475 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 035 000 | USD | 1 157 716 | 05.07.2023 |
| USD | 230 594 278 | CHF | 205 715 000 | 02.08.2023 |
| USD | 697 452 | CHF | 625 000 | 02.08.2023 |
| USD | 278 931 | CHF | 250 000 | 02.08.2023 |
| CHF | 4 000 000 | USD | 4 667 564 | 02.08.2023 |
| USD | 238 172 142 | CHF | 205 730 000 | 05.09.2023 |
| USD | 605 749 | CHF | 530 000 | 05.09.2023 |
| USD | 230 644 310 | CHF | 203 095 000 | 03.10.2023 |
| USD | 2 755 793 | CHF | 2 430 000 | 03.10.2023 |
| USD | 225 271 | CHF | 200 000 | 03.10.2023 |
| USD | 359 034 | CHF | 320 000 | 03.10.2023 |
| USD | 252 843 | CHF | 225 000 | 03.10.2023 |
| USD | 251 240 | CHF | 225 000 | 03.10.2023 |
| CHF | 4 310 000 | USD | 4 747 250 | 02.11.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|----------------------------|---------------------------|-------------------------|------------------------|-------------------|
| USD | 218 632 628 | CHF | 199 370 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 6 330 000 | USD | 6 908 866 | 02.11.2023 |
| USD | 177 569 | CHF | 160 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 9 425 000 | USD | 10 476 914 | 04.12.2023 |
| USD | 205 455 211 | CHF | 186 345 000 | 04.12.2023 |
| USD | 463 257 | CHF | 420 000 | 04.12.2023 |
| USD | 518 110 | CHF | 465 000 | 04.12.2023 |
| USD | 225 698 | CHF | 200 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 14 935 000 | USD | 16 975 777 | 04.12.2023 |
| USD | 198 972 939 | CHF | 172 420 000 | 03.01.2024 |
| USD | 247 173 | CHF | 215 000 | 03.01.2024 |
| USD | 3 442 333 | CHF | 3 000 000 | 03.01.2024 |
| USD | 11 083 045 | CHF | 9 745 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 1 070 000 | USD | 1 223 766 | 03.01.2024 |
| CHF | 184 310 000 | USD | 220 375 563 | 03.01.2024 |
| USD | 230 032 505 | CHF | 191 785 000 | 02.02.2024 |
| CHF | 230 000 | USD | 271 461 | 02.02.2024 |
| CHF | 29 950 000 | USD | 35 222 863 | 02.02.2024 |
| USD | 276 502 | CHF | 240 000 | 02.02.2024 |
| USD | 185 599 122 | CHF | 158 675 000 | 04.03.2024 |
| CHF | 670 000 | USD | 777 425 | 04.03.2024 |
| CHF | 8 375 000 | USD | 9 519 999 | 04.03.2024 |
| USD | 171 888 956 | CHF | 150 880 000 | 02.04.2024 |
| USD | 1 472 597 | CHF | 1 300 000 | 02.04.2024 |
| CHF | 575 000 | USD | 652 612 | 02.04.2024 |
| USD | 1 018 915 | CHF | 900 000 | 02.04.2024 |
| CHF | 152 505 000 | USD | 168 364 981 | 02.04.2024 |
| CHF | 130 000 | USD | 144 087 | 02.04.2024 |
| USD | 172 205 415 | CHF | 155 450 000 | 03.05.2024 |
| USD | 144 584 | CHF | 130 000 | 03.05.2024 |

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

| Position | Betrag in CHF | in % des Nettofonds- vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Brutto Gesamtengagement aus Derivaten | 155 235 643,68 | 99,47 |
| Netto Gesamtengagement aus Derivaten | – | – |
| Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften | – | – |

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Das Teilvermögen darf keine Pensionsgeschäfte tätigen.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:
*UBS (CH) Institutional Fund 3
Bonds Emerging Markets Sovereign Passive
(CHF hedged) II*
Klasse I-X

0,01%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurs

USD 1 = CHF 0.90

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen
Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|--|---------------------|---------------|---------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 32 757 721.04 | 85 363 686.54 | 124 671 022.85 |
| Klasse I-B | CH0229995755 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 779.20 | 1 711.99 | 1 817.90 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 1 779.20 | 1 711.99 | 1 817.90 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 3 886,7000 | 5 349,5130 | 7 597,5760 |
| Klasse I-X | CH0229995763 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 785.99 | 1 718.20 | 1 823.85 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 1 785.99 | 1 718.20 | 1 823.85 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 14 469,5940 | 44 351,9590 | 60 783,0280 |

¹ siehe Ergänzende Angaben

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-B | CHF | 5.6% | -5.0% | 10.8% |
| Klasse I-X | CHF | 5.6% | -4.9% | 10.9% |
| Benchmark: | | | | |
| SPI® (TR) | CHF | 6.2% | -6.4% | 10.9% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------|--------------|
| Schweiz | 97,16 |
| Österreich | 0,09 |
| TOTAL | 97,25 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 329 657.31 | 2 880 066.18 |
| Effekten | | |
| – Aktien und andere Beteiligungspapiere | 32 035 673.48 | 83 679 385.50 |
| Derivative Finanzinstrumente | 3 240.00 | 5 400.00 |
| Sonstige Vermögenswerte | 572 856.34 | 487 262.10 |
| Gesamtfondsvermögen | 32 941 427.13 | 87 052 113.78 |
| Aufgenommene Kredite | -183 268.60 | -1 687 989.62 |
| Andere Verbindlichkeiten | -437.49 | -437.62 |
| Nettofondsvermögen | 32 757 721.04 | 85 363 686.54 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 6 208.30 | 249.00 |
| Negativzinsen | -2 089.75 | -2 400.75 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren | 2 768 229.68 | 2 799 937.90 |
| – aus Gratisaktien | 0.00 | 97.94 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 549 796.88 | 303 110.41 |
| TOTAL Ertrag | 3 322 145.11 | 3 100 994.50 |
| Aufwand | | |
| Prüfaufwand | -16 300.40 | -12 530.90 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | -6 224.41 | -6 451.61 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -2 783.90 | -559.49 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -2 345 405.70 | -760 265.85 |
| TOTAL Aufwand | -2 370 714.41 | -779 807.85 |
| Nettoertrag | 951 430.70 | 2 321 186.65 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹ | 4 853 480.59 | 4 127 057.86 |
| Realisierter Erfolg | 5 804 911.29 | 6 448 244.51 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -3 384 624.27 | -13 390 631.77 |
| Gesamterfolg | 2 420 287.02 | -6 942 387.26 |

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

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|--------------------|---------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 951 430.70 | 2 321 186.65 |
| Zwischenthesaurierung ¹ | -588 674.15 | 0.00 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 362 756.55 | 2 321 186.65 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | 0.00 | -812 415.33 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | 0.00 | -1 508 771.32 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 362 756.55 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 85 363 686.54 | 124 671 022.85 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -1 249 085.87 | -1 098 749.58 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | -53 777 166.65 | -31 266 199.47 |
| Gesamterfolg | 2 420 287.02 | -6 942 387.26 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 32 757 721.04 | 85 363 686.54 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|--------------------|--------------------|
| Klasse I-B | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 5 349,5130 | 7 597,5760 |
| Ausgegebene Anteile | 2 089,1710 | 853,5780 |
| Zurückgenommene Anteile | -3 551,9840 | -3 101,6410 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 3 886,7000 | 5 349,5130 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -1 462,8130 | -2 248,0630 |
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 44 351,9590 | 60 783,0280 |
| Ausgegebene Anteile | 16 763,5130 | 7 680,5320 |
| Zurückgenommene Anteile | -46 645,8780 | -24 111,6010 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 14 469,5940 | 44 351,9590 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -29 882,3650 | -16 431,0690 |

¹ Zwischenthesaurierungen:

Klasse I-B: Zwischenthesaurierung (Brutto 31.252 / Ex-Datum 25.3.2024 / Valuta 27.3.2024)

Klasse I-X: Zwischenthesaurierung (Brutto 32.235 / Ex-Datum 25.3.2024 / Valuta 27.3.2024)

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Aufgrund der Vereinigung des Teilvermögens mit UBS (CH) Equity Fund – Switzerland Sustainable (CHF), per 7. Mai 2024, wird die Thesaurierung im aufnehmenden Teilvermögen vorgenommen.

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Inhaberaktien | | | | | | | | |
| Österreich | | | | | | | | |
| AMS AG NPV (BR)* | CHF | 41 872 | 196 014 | 209 189 | 28 697 | 30 060 | 0,09 | |
| TOTAL Österreich | | | | | | 30 060 | 0,09 | |
| Schweiz | | | | | | | | |
| COMET HOLDINGS CHF1 (REGD)* | CHF | 3 938 | 1 453 | 4 016 | 1 375 | 432 025 | 1,31 | |
| DAETWYLER HLDG CHF0.05 (POST SUBDIVISION)* | CHF | 3 079 | 1 160 | 3 101 | 1 138 | 211 668 | 0,64 | |
| IDORSIA AG CHF0.05* | CHF | 33 120 | 11 755 | 32 074 | 12 801 | 36 201 | 0,11 | |
| SWISS RE AG CHF0.10* | CHF | 37 431 | 19 882 | 42 394 | 14 919 | 1 729 858 | 5,25 | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 2 409 752 | 7,32 | |
| Total Inhaberaktien | | | | | | 2 439 812 | 7,41 | |
| Weitere Aktien | | | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | | | |
| ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV* | CHF | 41 643 | 21 984 | 47 177 | 16 450 | 3 778 565 | 11,47 | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 3 778 565 | 11,47 | |
| Total Weitere Aktien | | | | | | 3 778 565 | 11,47 | |
| Namensaktien | | | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | | | |
| ABB LTD CHF0.12 (REGD)* | CHF | 119 788 | 48 754 | 126 670 | 41 872 | 1 754 018 | 5,32 | |
| ACCELLERON INDUSTR CHF1* | CHF | 27 982 | 12 823 | 30 438 | 10 367 | 350 197 | 1,06 | |
| ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)* | CHF | 27 724 | 11 008 | 38 732 | | | | |
| ALCON AG CHF0.04* | CHF | | 31 899 | 20 665 | 11 234 | 839 629 | 2,55 | |
| ALSO HOLDING AG CHF1.00 (REGD)* | CHF | 2 181 | 3 155 | 3 930 | 1 406 | 329 004 | 1,00 | |
| BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)* | CHF | 888 | 463 | 1 024 | 327 | 428 043 | 1,30 | |
| BOSSARD HLDGS AG CHF5* | CHF | 3 527 | 1 405 | 3 649 | 1 283 | 280 977 | 0,85 | |
| CEMBRA MONEY BANK CHF1.00 (REGD)* | CHF | 12 380 | 6 600 | 13 973 | 5 007 | 378 029 | 1,15 | |
| GALDERMA GROUP AG CHF0.01* | CHF | | 2 200 | | 2 200 | 139 370 | 0,42 | |
| GEORG FISCHER AG CHF0.05 (REGD) (POST SPLIT)* | CHF | 3 520 | | 3 520 | | | | |
| JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)* | CHF | 33 870 | 13 540 | 34 991 | 12 419 | 646 782 | 1,96 | |
| LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)* | CHF | 19 105 | 5 834 | 24 939 | | | | |
| LONZA GROUP AG CHF1(REGD)* | CHF | 5 962 | 3 250 | 6 805 | 2 407 | 1 300 261 | 3,95 | |
| MEDMIX AG CHF0.01* | CHF | 24 029 | 10 285 | 34 314 | | | | |
| MEYER BURGER TECHN CHF0.05* | CHF | 1 089 878 | 446 063 | 1 535 941 | | | | |
| MOLECULAR PARTNERS CHF0.1* | CHF | 24 372 | 14 260 | 30 033 | 8 599 | 31 601 | 0,10 | |
| NESTLE SA CHF0.10(REGD)* | CHF | 146 543 | 59 213 | 153 103 | 52 653 | 5 041 525 | 15,30 | |
| NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)* | CHF | 130 345 | 53 583 | 136 185 | 47 743 | 4 171 306 | 12,66 | |
| R&S GROUP HOLDING AG CHF0.1* | CHF | 41 400 | 10 500 | 36 887 | 15 013 | 162 140 | 0,49 | |
| RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'* | CHF | 23 060 | 13 613 | 26 921 | 9 752 | 1 340 900 | 4,07 | |
| SANDOZ GROUP AG CHF0.05* | CHF | | 71 024 | 48 882 | 22 142 | 602 484 | 1,83 | |
| SFS GROUP AG CHF0.1* | CHF | 2 900 | 9 630 | 9 401 | 3 129 | 371 099 | 1,13 | |
| SGS SA CHF0.04* | CHF | | 19 824 | 13 875 | 5 949 | 520 538 | 1,58 | |
| SIG COMBIBLOC GROU CHF0.1* | CHF | 57 341 | 23 228 | 59 429 | 21 140 | 422 800 | 1,28 | |
| SOFTWAREONE HLD AG CHF0.01* | CHF | 68 480 | 26 288 | 74 950 | 19 818 | 329 375 | 1,00 | |
| SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)* | CHF | 6 446 | 3 864 | 9 702 | 608 | 158 749 | 0,48 | |
| SULZER AG CHF0.01* | CHF | 7 458 | 3 042 | 10 500 | | | | |
| SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)* | CHF | 4 190 | 1 718 | 4 364 | 1 544 | 976 117 | 2,96 | |
| UBS GROUP CHF0.10 (REGD)* | CHF | 310 034 | 120 823 | 328 112 | 102 745 | 2 850 146 | 8,65 | |
| VONTOBEL HLDGS AG CHF1(REGD)* | CHF | 11 733 | 4 833 | 12 288 | 4 278 | 234 007 | 0,71 | |
| ZÜRICH INSURANCE GRP CHF0.10* | CHF | 11 695 | 5 207 | 12 464 | 4 438 | 2 158 199 | 6,55 | |
| TOTAL Schweiz | | | | | | 25 817 296 | 78,37 | |
| Total Namensaktien | | | | | | 25 817 296 | 78,37 | |

| Titel | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| Anrechte | | | | | | | |
| Österreich | | | | | | | |
| AMS-OSRAM AG RIGHTS 23-06.12.23* | CHF | 63 437 | 63 437 | | | | |
| TOTAL Österreich | | | | | | 0,00 | |
| Total Anrechte | | | | | | 0,00 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 32 035 673 | 97,25 | |
| Total Wertschriften | | | | | 32 035 673 | 97,25 | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | 0,00 | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | 329 657 | 1,00 | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | 3 240 | 0,01 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 572 857 | 1,74 | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | 32 941 427 | 100,00 | |
| Aufgenommene Kredite | | | | | -183 269 | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | -437 | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | 32 757 721 | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 32 038 913 | 97,26 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | – | – |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 32 038 913 | 97,26 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

| Instrument | Nominal | Währung | Deckung in CHF | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|--|---------|---------|-------------------|----------------------------------|-----------------------|
| Optionen/Warrants auf Aktien/Aktienbaskets | | | | | |
| VTS ACQUISITION COMPANY CALL WARRANT 11.50000 21-16.12.27* | 3 600 | CHF | 0 | 3 240 | 0,01 |
| | | | 0 | 3 240 | 0,01 |

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

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

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| Optionen/Warrants auf Aktien/Aktienbaskets | | | |
| VTS ACQUISITION COMPANY CALL WARRANT 11.50000 21-16.12.27 | CHF | 0 | 14 400 |

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

| Position | Betrag in CHF | in % des Nettofonds- vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Brutto Gesamtengagement aus Derivaten | 12 988,25 | 0,04 |
| Netto Gesamtengagement aus Derivaten | – | – |
| Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften | – | – |

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Einzahlung in Effekten statt in bar

UBS (CH) Institutional Fund 3

– *Equities Switzerland II Klasse I-X*

Während der Berichtsperiode wurden Effekten (statt in bar) im Gegenwert von 21 909 188,67 CHF eingebracht, was 12 290,3740 Anteilen entspricht.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

UBS (CH) Institutional Fund 3

– *Equities Switzerland II*

Klasse I-B

0,07%

Klasse I-X

0,02%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

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

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Bonds CHF Short Term II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|--|---------------------|------------------|------------------|------------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 1 074 519 387.16 | 1 188 242 870.18 | 1 284 105 047.50 |
| Klasse I-A1 | CH0232004066 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 963.14 | 942.46 | 944.25 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 964.20 | 943.31 | 943.97 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 36 824,0870 | 40 792,1870 | 62 233,8840 |
| Klasse I-B | CH0232006095 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 972.78 | 950.79 | 951.53 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 973.85 | 951.65 | 951.24 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 144 557,8910 | 109 109,3030 | 142 263,5280 |
| Klasse I-X | CH0232006111 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 977.37 | 955.07 | 955.58 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹ | | 978.45 | 955.93 | 955.29 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 919 228,3130 | 1 095 273,1410 | 1 140 636,3170 |

¹ siehe Ergänzende Angaben

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|-------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-A1 | CHF | 2.4% | 0.1% | -0.8% |
| Klasse I-B | CHF | 2.6% | 0.3% | -0.6% |
| Klasse I-X | CHF | 2.6% | 0.3% | -0.6% |
| Benchmark: ¹ | | | | |
| SARON 3M compounded | CHF | 1.6% | -0.0% | -0.7% |

¹ Benchmark bis 30.7.2021 Libor CHF 3 Months, ab 1.8.2021 SARON 3M compounded

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|------------------------------|--------------|
| Schweiz | 42,22 |
| Grossbritannien | 6,02 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 5,91 |
| Südkorea | 4,66 |
| Österreich | 4,42 |
| Supranational | 4,35 |
| Kanada | 4,01 |
| Frankreich | 3,79 |
| Katar | 3,46 |
| Chile | 3,09 |
| Übrige | 16,31 |
| TOTAL | 98,24 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|---------------------------|----------------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 9 776 902.13 ¹ | 24 797 651.25 ² |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 1 066 115 872.17 | 1 167 098 389.10 |
| Derivative Finanzinstrumente | 671 438.00 | 10 297 160.00 |
| Sonstige Vermögenswerte | 8 717 973.47 | 6 055 348.65 |
| Gesamtfondsvermögen | 1 085 282 185.77 | 1 208 248 549.00 |
| Aufgenommene Kredite | -10 752 507.41 | -19 994 127.80 |
| Andere Verbindlichkeiten | -10 291.20 | -11 551.02 |
| Nettofondsvermögen | 1 074 519 387.16 | 1 188 242 870.18 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 106 742.05 | 22 396.17 |
| Negativzinsen | -40 229.81 | -128 842.81 |
| Erträge der Geldmarktinstrumente | 0.00 | 2 640.00 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 12 447 141.37 | 9 303 470.03 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 475 977.04 | 577 041.41 |
| TOTAL Ertrag | 12 989 630.65 | 9 776 704.80 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | -81 260.47 | -19 623.06 |
| Prüfaufwand | -19 531.40 | -17 377.40 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1 | -78 047.81 | -109 321.82 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | -45 750.57 | -42 516.03 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | -11.31 |
| Sonstige Aufwendungen | -3 701.90 | -559.49 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -1 289 967.79 | -720 759.42 |
| TOTAL Aufwand | -1 518 259.94 | -910 168.53 |
| Nettoertrag | 11 471 370.71 | 8 866 536.27 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste ³ | -998 391.76 | -12 024 437.09 |
| Realisierter Erfolg | 10 472 978.95 | -3 157 900.82 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 17 931 398.08 | 4 707 410.63 |
| Gesamterfolg | 28 404 377.03 | 1 549 509.81 |

¹ Zum 31. März 2024 wurde von UBS AG London Bankguthaben in Höhe von CHF 755 000.00 als Sicherheit entgegengenommen.

² Zum 31. März 2023 wurde von UBS AG London Bankguthaben in Höhe von CHF 9 245 000.00 als Sicherheit entgegengenommen.

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

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|----------------------|---------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 11 471 370.71 | 8 866 536.27 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 11 471 370.71 | 8 866 536.27 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | -4 014 979.75 | -3 103 287.69 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -7 456 390.96 | -5 763 248.58 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-------------------------|-------------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 1 188 242 870.18 | 1 284 105 047.50 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -3 008 319.00 | -3 369 610.36 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | -139 119 541.05 | -94 042 076.77 |
| Gesamterfolg | 28 404 377.03 | 1 549 509.81 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 1 074 519 387.16 | 1 188 242 870.18 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|-----------------------|
| | Anzahl | Anzahl |
| Klasse I-A1 | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 40 792,1870 | 62 233,8840 |
| Ausgegebene Anteile | 9 116,8050 | 1 154,9760 |
| Zurückgenommene Anteile | -13 084,9050 | -22 596,6730 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 36 824,0870 | 40 792,1870 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -3 968,1000 | -21 441,6970 |
| Klasse I-B | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 109 109,3030 | 142 263,5280 |
| Ausgegebene Anteile | 37 503,4510 | 5 373,0910 |
| Zurückgenommene Anteile | -2 054,8630 | -38 527,3160 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 144 557,8910 | 109 109,3030 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 35 448,5880 | -33 154,2250 |
| Klasse I-X | | |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 1 095 273,1410 | 1 140 636,3170 |
| Ausgegebene Anteile | 61 182,7170 | 200 625,9020 |
| Zurückgenommene Anteile | -237 227,5450 | -245 989,0780 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 919 228,3130 | 1 095 273,1410 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -176 044,8280 | -45 363,1760 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Klasse I-A1

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|--------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 8.377 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -2.932 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 5.445 |

Klasse I-B

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 10.128 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -3.545 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 6.583 |

Klasse I-X

Thesaurierung per 16.7.2024

| | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 10.550 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -3.693 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 6.857 |

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon | |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|-----------------------------------|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
| Notes, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEN-REG-S 3.10000% 22-19.12.25* | CHF | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 424 500 | 0,13 | |
| ALPIQ HOLDING AG-REG-S 1.62500% 22-30.05.25* | CHF | 8 400 000 | | 8 400 000 | 8 386 560 | 0,77 | |
| ALPIQ HOLDING LTD 2.12500% 15-30.06.23* | CHF | 3 115 000 | 3 115 000 | | | | |
| CAISSE DE REFINANCE DE L'HABITAT-REG-S 2.37500% 12-05.03.24* | CHF | 7 100 000 | 7 100 000 | | | | |
| EBN BV-REG-S 1.12500% 12-04.07.24* | CHF | 950 000 | 950 000 | | | | |
| ENERGIEFINANZIERUNGS AG-REG-S 3.05000% 23-04.07.25* | CHF | 14 635 000 | | 14 635 000 | 14 815 011 | 1,37 | |
| INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.05000% 19-09.10.23* | CHF | 20 950 000 | 1 185 000 | 22 135 000 | | | |
| ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25* | CHF | 6 940 000 | | 6 940 000 | 6 884 480 | 0,63 | |
| NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.25000% 15-23.10.23* | CHF | 1 000 000 | 1 000 000 | | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER INST-REG-S 1.37500% 12-14.02.24* | CHF | 20 000 000 | 20 000 000 | | | | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-REG-S 1.62500% 14-16.05.24* | CHF | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 999 600 | 0,37 | |
| REPOWER AG-REG-S 2.55000% 22-09.12.24* | CHF | 11 625 000 | | 11 625 000 | 11 700 563 | 1,08 | |
| SIKA AG-REG-S 1.90000% 22-28.11.25* | CHF | 8 275 000 | | 8 275 000 | 8 328 788 | 0,77 | |
| SPITAL LIMMATTAL-REG-S 1.87500% 13-29.11.23* | CHF | 400 000 | 400 000 | | | | |
| SWISSGRID AG-REG-S 1.90000% 23-30.06.26* | CHF | 9 285 000 | | 9 285 000 | 9 382 492 | 0,86 | |
| WURTH FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 2.10000% 22-16.11.26* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 015 500 | 0,09 | |
| TOTAL CHF | | | | | 65 937 493 | 6,08 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | 65 937 493 | 6,08 | |

Medium-Term Notes, fester Zins

| | | | | | | | |
|---|-----|------------|------------|------------|------------|------|--|
| CHF | | | | | | | |
| ABN AMRO BANK NV 1.50000% 12-18.07.23* | CHF | 12 170 000 | 12 170 000 | | | | |
| ACHMEA BANK NV-REG-S 2.47000% 23-16.10.26* | CHF | 5 000 000 | | 5 000 000 | 5 100 000 | 0,47 | |
| ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.72500% 18-15.02.24* | CHF | 330 000 | 330 000 | | | | |
| ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24* | CHF | 670 000 | | 670 000 | 664 372 | 0,06 | |
| ADECCO SA-REG-S 0.87500% 20-27.11.25* | CHF | 4 000 000 | | 4 000 000 | 3 962 000 | 0,37 | |
| AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23* | CHF | 2 890 000 | 170 000 | 3 060 000 | | | |
| AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23* | CHF | 470 000 | 470 000 | | | | |
| AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24* | CHF | 1 250 000 | | 1 250 000 | 1 242 875 | 0,11 | |
| ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24* | CHF | 450 000 | 450 000 | | | | |
| ASB BANK LTD-REG-S 0.45000% 19-30.01.25* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | 991 700 | 0,09 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.40750% 22-28.11.25* | CHF | 10 000 000 | | 10 000 000 | 10 135 000 | 0,93 | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24* | CHF | 2 200 000 | 650 000 | 2 200 000 | 644 540 | 0,06 | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.25000% 19-29.10.25* | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | 1 950 000 | 0,18 | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26* | CHF | | 3 500 000 | 3 500 000 | 3 335 500 | 0,31 | |
| BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24* | CHF | 1 400 000 | 5 400 000 | 6 800 000 | 6 748 320 | 0,62 | |
| BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.44100% 18-21.12.23* | CHF | 2 970 000 | | 2 970 000 | | | |
| BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 0.29750% 21-22.10.26* | CHF | | 2 500 000 | 2 500 000 | 2 388 750 | 0,22 | |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24* | CHF | | 3 000 000 | 3 000 000 | 2 987 100 | 0,28 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.04250% 23-04.05.26* | CHF | | 15 300 000 | 15 300 000 | 15 506 550 | 1,43 | |
| BARCLAYS PLC-REG-S 1.12500% 18-12.07.23* | CHF | 6 200 000 | 6 200 000 | | | | |
| BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23* | CHF | 11 200 000 | 11 200 000 | | | | |
| BPCE SA-REG-S 2.38250% 23-12.06.26* | CHF | | 10 000 000 | 10 000 000 | 10 180 000 | 0,94 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMER-REG-S 0.10000% 20-24.10.23* | CHF | 3 990 000 | 3 990 000 | | | | |
| CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.60000% 19-30.01.25* | CHF | | 1 000 000 | 1 000 000 | 992 500 | 0,09 | |
| CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23* | CHF | 12 850 000 | 12 850 000 | | | | |
| CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24* | CHF | 7 500 000 | | 7 500 000 | 7 488 750 | 0,69 | |
| CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.31400% 18-05.09.24* | CHF | 13 955 000 | 3 630 000 | 17 585 000 | 17 484 766 | 1,61 | |
| CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.20000% 19-25.03.24* | CHF | 11 680 000 | 5 900 000 | 17 580 000 | | | |
| CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.40500% 20-25.06.25* | CHF | | 12 000 000 | 12 000 000 | 11 818 800 | 1,09 | |
| CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 17-22.11.24* | CHF | 400 000 | 1 500 000 | 1 900 000 | 1 887 460 | 0,17 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUS-REG-S 0.87500% 22-02.09.25* | CHF | 17 220 000 | | 17 220 000 | 17 094 294 | 1,58 | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.20000% 14-05.02.24* | CHF | 17 805 000 | 17 805 000 | | | | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.45000% 15-07.09.23* | CHF | 8 590 000 | 8 590 000 | | | | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.30400% 16-16.09.24* | CHF | 4 120 000 | 615 000 | 4 735 000 | 4 704 223 | 0,43 | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25* | CHF | | 1 000 000 | 1 000 000 | 987 100 | 0,09 | |
| CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23* | CHF | 11 195 000 | 11 195 000 | | | | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 1.12500% 14-05.06.24* | CHF | 400 000 | 755 000 | 1 155 000 | 1 154 192 | 0,11 | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 15-27.01.25* | CHF | | 1 300 000 | 1 300 000 | 1 295 320 | 0,12 | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.62500% 17-12.07.24* | CHF | 300 000 | | 300 000 | 299 190 | 0,03 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.62500% 15-19.12.23* | CHF | 18 610 000 | 18 610 000 | | | | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25* | CHF | 200 000 | | | 200 000 | 198 520 | 0,02 | |
| DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24* | CHF | 550 000 | | 550 000 | | | | |
| DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24* | CHF | 16 750 000 | 350 000 | 17 100 000 | | | | |
| DZ BANK GENOSSENSCHAFTSBANK AG-SUB 3.23800% 13-30.08.23* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| EBN BV-REG-S 1.62500% 11-03.10.23* | CHF | 960 000 | | 960 000 | | | | |
| ELO SACA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24* | CHF | 970 000 | 400 000 | | 1 370 000 | 1 363 150 | 0,13 | |
| ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 23-15.06.26* | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 5 067 500 | 0,47 | |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.55000% 17-03.09.24* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 497 850 | 0,05 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.32250% 18-27.09.23* | CHF | 10 645 000 | | 10 645 000 | | | | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24* | CHF | 21 000 000 | 10 570 000 | | 31 570 000 | 31 339 539 | 2,89 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25* | CHF | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 2 437 500 | 0,22 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.50000% 17-04.12.24* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.50000% 16-17.05.24* | CHF | 2 420 000 | 1 400 000 | | 3 820 000 | 3 814 270 | 0,35 | |
| HENKEL AG & CO KGAA 0.27250% 20-28.04.23* | CHF | 6 185 000 | | 6 185 000 | | | | |
| HYPO NOE GRUPPE BANK AG 0.12500% 16-17.10.23* | CHF | 5 160 000 | | 5 160 000 | | | | |
| HYPO NOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24* | CHF | 1 100 000 | 6 515 000 | | 7 615 000 | 7 541 896 | 0,69 | |
| HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.45000% 18-05.03.24* | CHF | 1 130 000 | 650 000 | 1 780 000 | | | | |
| HYPO VORARLBERG BANK-REG-S 0.25000% 18-12.11.25* | CHF | | 10 000 000 | | 10 000 000 | 9 810 000 | 0,90 | |
| HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 2.37500% 23-04.05.26* | CHF | | 11 580 000 | | 11 580 000 | 11 724 750 | 1,08 | |
| HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.75250% 20-06.07.23* | CHF | 27 000 000 | | 27 000 000 | | | | |
| INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 397 040 | 0,04 | |
| JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.37500% 17-18.07.25* | CHF | | 7 400 000 | | 7 400 000 | 7 274 200 | 0,67 | |
| KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG-REG-S 2.00000% 19-14.02.25* | CHF | | 4 880 000 | | 4 880 000 | 4 888 784 | 0,45 | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.30300% 18-14.06.23* | CHF | 2 210 000 | | 2 210 000 | | | | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25* | CHF | | 845 000 | 845 000 | | | | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 2.22250% 23-24.07.26* | CHF | | 20 000 000 | | 20 000 000 | 20 350 000 | 1,88 | |
| KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 0.25000% 17-07.06.24* | CHF | | 600 000 | 600 000 | | | | |
| KOREA GAS CORP-REG-S 0.20750% 18-02.08.23* | CHF | 1 275 000 | | 1 275 000 | | | | |
| LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.87500% 14-16.09.24* | CHF | | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 594 080 | 0,15 | |
| MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24* | CHF | | 4 200 000 | | 4 200 000 | 4 152 960 | 0,38 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.30000% 17-20.12.24* | CHF | | 3 720 000 | 3 720 000 | | | | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.35000% 18-12.12.23* | CHF | 3 720 000 | | 3 720 000 | | | | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 18-31.10.24* | CHF | | 2 900 000 | | 2 900 000 | 2 875 350 | 0,26 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.00100% 19-19.02.24* | CHF | 6 370 000 | | 6 370 000 | | | | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25* | CHF | | 7 000 000 | | 7 000 000 | 6 818 000 | 0,63 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.50000% 14-07.02.24* | CHF | 3 510 000 | | 3 510 000 | | | | |
| NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.12500% 19-13.09.23* | CHF | 4 600 000 | | 4 600 000 | | | | |
| NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25* | CHF | 30 000 000 | | | 30 000 000 | 29 823 000 | 2,75 | |
| NORSKE TOG-REG-S 1.12500% 13-02.05.23* | CHF | 7 550 000 | | 7 550 000 | | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 17-25.03.24* | CHF | 23 000 000 | | 23 000 000 | | | | |
| QNB FINANCE LTD-REG-S 0.02500% 21-03.06.24* | CHF | 30 000 000 | 200 000 | | 30 200 000 | 30 100 038 | 2,77 | |
| QUEBEC, PROVINCE OF 1.50000% 14-05.02.24* | CHF | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | | |
| RCI BANQUE SA-REG-S 0.55000% 18-30.05.23* | CHF | 4 430 000 | | 4 430 000 | | | | |
| RCI BANQUE SA-REG-S 0.50000% 19-18.07.24* | CHF | 1 280 000 | 13 340 000 | | 14 620 000 | 14 555 672 | 1,34 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.49500% 22-08.07.25* | CHF | 10 000 000 | 1 000 000 | | 11 000 000 | 11 019 800 | 1,02 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.47500% 23-30.01.26* | CHF | | 950 000 | | 950 000 | 951 425 | 0,09 | |
| SANTANDER UK PLC-REG-S 2.01000% 23-12.09.26* | CHF | | 6 600 000 | | 6 600 000 | 6 699 000 | 0,62 | |
| SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.38500% 21-22.07.26* | CHF | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 2 411 250 | 0,22 | |
| SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 2.78250% 23-23.05.25* | CHF | | 10 000 000 | | 10 000 000 | 10 114 000 | 0,93 | |
| SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.37500% 15-21.08.23* | CHF | 1 400 000 | | 1 400 000 | | | | |
| SOCIETE GENERALE-REG-S 0.87500% 19-28.02.24* | CHF | 6 200 000 | | 6 200 000 | | | | |
| SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.25000% 13-17.07.23* | CHF | 900 000 | | 900 000 | | | | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.25000% 19-11.10.23* | CHF | 665 000 | | 665 000 | | | | |
| TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.15000% 21-26.04.24* | CHF | 5 000 000 | 1 000 000 | | 6 000 000 | 5 932 800 | 0,55 | |
| TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.97000% 23-18.09.26* | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 5 070 000 | 0,47 | |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 698 530 | 0,06 | |
| TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.62500% 16-23.06.23* | CHF | 13 690 000 | | 13 690 000 | | | | |
| TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 1.00000% 18-08.12.25* | CHF | | 800 000 | | 800 000 | 792 400 | 0,07 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.37500% 17-31.05.23* | CHF | 2 200 000 | | 2 200 000 | | | | |
| VODAFONE GROUP PLC-REG-S 0.37500% 16-03.12.24* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 496 000 | 0,05 | |
| VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 2.20750% 24-12.02.27* | CHF | | 4 645 000 | | 4 645 000 | 4 710 030 | 0,43 | |
| WELLS FARGO & CO-REG-S 0.50000% 15-02.11.23* | CHF | 5 250 000 | | 5 250 000 | | | | |
| TOTAL CHF | | | | | | 376 562 634 | 34,70 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 376 562 634 | 34,70 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Medium-Term Notes, Nullcoupon | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24* | CHF | 800 000 | | 800 000 | | | |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.00000% 19-11.07.25* | CHF | | 4 530 000 | | 4 530 000 | 4 455 255 | 0,41 |
| TOYOTA MOTOR FINANCE NETHER BV-REG-S 0.00000% 21-21.05.24* | CHF | 30 000 000 | 1 800 000 | | 31 800 000 | 31 706 093 | 2,92 |
| TOTAL CHF | | | | | | 36 161 348 | 3,33 |
| Total Medium-Term Notes, Nullcoupon | | | | | | 36 161 348 | 3,33 |

Anleihen, fester Zins

| | | | | | | | |
|--|-----|------------|------------|------------|------------|------------|------|
| CHF | | | | | | | |
| ABB LTD 1.96500% 23-22.09.26* | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 5 077 500 | 0,47 |
| AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 1.05000% 20-26.05.23* | CHF | 27 000 000 | | 27 000 000 | | | |
| AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEILIGUNGEN 1.62500% 16-09.06.23* | CHF | 3 750 000 | | 3 750 000 | | | |
| ALLREAL HOLDING AG 0.62500% 16-10.05.24* | CHF | 1 130 000 | 4 785 000 | | 5 915 000 | 5 907 311 | 0,54 |
| ALLREAL HOLDING AG-REG-S 1.37500% 15-31.03.25* | CHF | 2 425 000 | | | 2 425 000 | 2 414 815 | 0,22 |
| ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.50000% 18-19.04.23* | CHF | 250 000 | | 250 000 | | | |
| ALPIQ HOLDING AG-REG-S 2.62500% 14-29.07.24* | CHF | | 4 380 000 | | 4 380 000 | 4 392 264 | 0,40 |
| AMAG LEASING AG 2.62500% 23-26.05.26* | CHF | | 20 000 000 | 2 000 000 | 18 000 000 | 18 270 000 | 1,68 |
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.87500% 17-25.10.24* | CHF | 440 000 | | 440 000 | | | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.25000% 21-27.10.23* | CHF | 23 500 000 | 435 000 | | 23 935 000 | | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.12500% 20-12.02.24* | CHF | 450 000 | | 450 000 | | | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.21000% 21-27.06.24* | CHF | 2 600 000 | | 2 600 000 | | | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 2.73000% 23-04.09.26* | CHF | | 6 000 000 | | 6 000 000 | 6 102 000 | 0,56 |
| AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24* | CHF | | 1 530 000 | | 1 530 000 | 1 530 153 | 0,14 |
| BALOISE HOLDING-REG-S 0.25000% 20-16.12.26* | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 4 842 500 | 0,45 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26* | CHF | | 2 400 000 | | 2 400 000 | 2 311 200 | 0,21 |
| BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | |
| BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24* | CHF | | 2 195 000 | | 2 195 000 | 2 160 978 | 0,20 |
| BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23* | CHF | 710 000 | | 710 000 | | | |
| BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 2.87000% 22-03.10.25* | CHF | 10 000 000 | 5 000 000 | | 15 000 000 | 15 232 500 | 1,40 |
| BANK OF MONTREAL-REG-S 0.09600% 20-22.12.23* | CHF | 2 000 000 | 200 000 | 2 200 000 | | | |
| BELL FOOD GROUP AG -REG-S 0.62500% 16-24.03.25* | CHF | | 3 500 000 | | 3 500 000 | 3 464 650 | 0,32 |
| BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.37500% 18-01.02.24* | CHF | 6 980 000 | 13 930 000 | 20 910 000 | | | |
| BELL FOOD GROUP AG-REG-S 2.30000% 23-15.10.26* | CHF | | 20 000 000 | | 20 000 000 | 20 360 000 | 1,88 |
| BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23* | CHF | 200 000 | | 200 000 | | | |
| BOBST GROUP SA-REG-S 1.12500% 18-27.09.24* | CHF | | 7 850 000 | | 7 850 000 | 7 817 815 | 0,72 |
| BUCHER INDUSTRIES AG-REG-S 1.37500% 14-02.10.24* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | 399 280 | 0,04 |
| CAISSE DE REFINANC DE L'HABITAT-REG-S 1.75000% 13-26.06.25* | CHF | 11 500 000 | | 11 500 000 | | 11 534 500 | 1,06 |
| COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.87500% 15-31.07.24* | CHF | | 450 000 | | 450 000 | 448 875 | 0,04 |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.30000% 17-07.04.25* | CHF | 12 375 000 | | | 12 375 000 | 12 212 888 | 1,13 |
| DANSKE BANK A/S-REG-S 1.81000% 23-05.10.26* | CHF | | 10 000 000 | | 10 000 000 | 10 115 000 | 0,93 |
| DBS BANK LTD-REG-S 1.51500% 22-12.12.25* | CHF | 20 000 000 | 5 000 000 | | 25 000 000 | 25 012 500 | 2,30 |
| DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23* | CHF | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | |
| DH SWITZERLAND FINANCE SA-REG-S 0.50000% 15-08.12.23* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | |
| DIGITAL INTREPID HOLDING B-REG-S 0.60000% 22-02.10.23* | CHF | 22 500 000 | | 22 500 000 | | | |
| DORMAKABA FINANCE AG-REG-S 1.00000% 17-13.10.25* | CHF | | 7 000 000 | | 7 000 000 | 6 912 500 | 0,64 |
| ENGADINER KRAFTWERKE AG-REG-S 1.62500% 14-25.04.24* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 499 950 | 0,05 |
| FEDERATION DES CAISSES DESJ DU QUEB 1.35500% 24-18.04.27* | CHF | | 10 000 000 | | 10 000 000 | 9 994 100 | 0,92 |
| FERRING HOLDING SA-REG-S 1.05000% 20-09.07.25* | CHF | | 18 000 000 | | 18 000 000 | 17 841 600 | 1,64 |
| FIRMENICH INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 20-19.12.23* | CHF | 26 500 000 | 9 200 000 | 35 700 000 | | | |
| FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.70000% 20-22.05.24* | CHF | 45 000 | | | 45 000 | 44 942 | 0,00 |
| FONDO FINANCIERO-REG-S 0.57800% 19-11.03.24* | CHF | 4 705 000 | 795 000 | 5 500 000 | | | |
| GALENICA SANTE LTD-REG-S 0.50000% 17-15.06.23* | CHF | 4 525 000 | | 4 525 000 | | | |
| GEBERIT AG-REG-S 0.10000% 19-17.10.24* | CHF | 90 000 | | | 90 000 | 89 298 | 0,01 |
| GEBERIT AG-REG-S 2.25000% 23-26.09.25* | CHF | 7 000 000 | | 2 000 000 | 5 000 000 | 5 059 000 | 0,47 |
| GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.62500% 11-28.11.23* | CHF | 2 360 000 | | 2 360 000 | | | |
| GRANDE DIXENCE SA-REG-S 1.12500% 17-04.07.24* | CHF | | 1 645 000 | | 1 645 000 | 1 642 204 | 0,15 |
| GRANDE DIXENCE SA-REG-S 1.25000% 18-06.06.23* | CHF | 160 000 | | 160 000 | | | |
| GS CALTEX CORP-REG-S 0.63300% 18-31.01.24* | CHF | 1 670 000 | 995 000 | 2 665 000 | | | |
| HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 16-04.07.23* | CHF | 17 845 000 | | 17 845 000 | | | |
| HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 0.87500% 19-08.05.24* | CHF | 8 690 000 | 9 070 000 | | 17 760 000 | 17 735 136 | 1,63 |
| INTERSHOP HOLDING AG 1.12500% 15-17.04.23* | CHF | 11 205 000 | | 11 205 000 | | | |
| KEB HANA BANK-REG-S 0.40750% 18-14.09.23* | CHF | 7 550 000 | | 7 550 000 | | | |
| KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG-REG-S 1.50000% 18-07.08.24* | CHF | | 3 700 000 | | 3 700 000 | 3 696 670 | 0,34 |
| KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 2.15500% 22-14.10.25* | CHF | 10 000 000 | | | 10 000 000 | 10 095 000 | 0,93 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | |
| KOREA HOUSING FINANCE CORP 1.81500% 23-10.02.26* | CHF | 20 000 000 | | | 20 000 000 | 20 110 000 | 1,85 |
| KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.75000% 11-09.06.23* | CHF | 3 425 000 | | 3 425 000 | | | |
| KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 1.25000% 14-11.09.24* | CHF | 1 060 000 | | | 1 060 000 | 1 057 774 | 0,10 |
| KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.00000% 17-11.12.23* | CHF | 9 200 000 | 3 500 000 | 12 700 000 | | | |
| KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.20000% 19-18.06.25* | CHF | | 170 000 | | 170 000 | 167 263 | 0,02 |
| LAUSANNE, CITY OF-REG-S 1.37500% 13-27.11.23* | CHF | 2 200 000 | | 2 200 000 | | | |
| LONZA SWISS FINANCE AG 1.25000% 15-22.09.23* | CHF | 3 775 000 | 500 000 | 4 275 000 | | | |
| MOBIMO HOLDING AG-REG-S 1.87500% 14-16.09.24* | CHF | 250 000 | 13 400 000 | | 13 650 000 | 13 656 825 | 1,26 |
| MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.87500% 18-02.10.23* | CHF | 26 595 000 | | 26 595 000 | | | |
| NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.75000% 14-18.07.24* | CHF | | 9 035 000 | | 9 035 000 | 9 035 904 | 0,83 |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.75750% 23-23.01.26* | CHF | 20 000 000 | | | 20 000 000 | 20 070 000 | 1,85 |
| NESTLE SA 1.62500% 22-07.11.25* | CHF | 15 000 000 | | | 15 000 000 | 15 075 000 | 1,39 |
| OC OERLIKON CORP AG-REG-S 2.62500% 14-17.06.24* | CHF | | 260 000 | 260 000 | | | |
| OC OERLIKON CORP INC, PFAEFF-REG-S 2.87500% 23-02.06.26* | CHF | | 25 000 000 | 2 000 000 | 23 000 000 | 23 264 500 | 2,14 |
| OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG-REG-S 2.62500% 06-22.11.24* | CHF | | 3 665 000 | | 3 665 000 | 3 694 320 | 0,34 |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG-REG-S 0.15000% 17-07.06.24* | CHF | 10 270 000 | 4 500 000 | | 14 770 000 | 14 730 121 | 1,36 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERSHR HYPO INST-REG-S 2.37500% 11-25.01.24* | CHF | 6 000 000 | | 6 000 000 | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEZ KANTONALBNKN-REG-S 2.00000% 10-30.10.25* | CHF | | 4 050 000 | | 4 050 000 | 4 093 740 | 0,38 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 2.12500% 10-28.06.23* | CHF | 14 000 000 | | 14 000 000 | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.12500% 12-16.11.23* | CHF | 10 800 000 | | 10 800 000 | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.25000% 13-29.09.23* | CHF | 20 000 000 | | 20 000 000 | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 14-14.11.24* | CHF | | 665 000 | | 665 000 | 664 535 | 0,06 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 14-23.08.24* | CHF | 3 400 000 | 505 000 | | 3 905 000 | 3 893 285 | 0,36 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 15-04.12.23* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 15-24.01.25* | CHF | | 6 000 000 | | 6 000 000 | 5 955 600 | 0,55 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 15-15.10.25* | CHF | | 2 800 000 | | 2 800 000 | 2 760 800 | 0,25 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 17-06.05.25* | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 973 800 | 0,18 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 18-26.04.24* | CHF | 1 100 000 | 2 800 000 | | 3 900 000 | 3 896 880 | 0,36 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.62500% 11-31.10.24* | CHF | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 3 002 100 | 0,28 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.25000% 12-17.07.24* | CHF | 2 250 000 | | | 2 250 000 | 2 247 750 | 0,21 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.37500% 13-16.04.25* | CHF | | 9 500 000 | | 9 500 000 | 9 501 900 | 0,88 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.62500% 14-17.06.26* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 403 080 | 0,04 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.37500% 14-15.04.24* | CHF | 4 000 000 | 4 200 000 | 500 000 | 7 700 000 | 7 697 690 | 0,71 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.75000% 14-23.09.24* | CHF | 5 000 000 | | | 5 000 000 | 4 982 000 | 0,46 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 14-20.01.23* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 15-12.03.24* | CHF | 6 300 000 | | 6 300 000 | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.37500% 15-15.09.25* | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 960 100 | 0,27 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 15-17.07.24* | CHF | 9 450 000 | 1 500 000 | | 10 950 000 | 10 905 105 | 1,00 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.12500% 15-25.02.26* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 489 200 | 0,05 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 16-02.12.24* | CHF | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 478 000 | 0,23 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.01000% 17-05.02.24* | CHF | 7 120 000 | | 7 120 000 | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 18-31.10.24* | CHF | | 5 035 000 | | 5 035 000 | 4 996 231 | 0,46 |
| PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 1.00000% 15-06.02.25* | CHF | 5 275 000 | | | 5 275 000 | 5 249 680 | 0,48 |
| PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.50000% 16-16.02.24* | CHF | 13 960 000 | 2 420 000 | 16 380 000 | | | |
| PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.37500% 16-29.04.26* | CHF | | 2 695 000 | | 2 695 000 | 2 628 973 | 0,24 |
| PSP SWISS PROPERTY AG 1.80000% 23-11.12.26* | CHF | | 10 000 000 | | 10 000 000 | 10 060 000 | 0,93 |
| ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.10000% 17-23.09.24* | CHF | 1 810 000 | | 1 810 000 | | | |
| SANDOZ GROUP AG-REG-S 2.12500% 23-17.11.26* | CHF | | 15 315 000 | | 15 315 000 | 15 544 725 | 1,43 |
| SGS SA 0.25000% 15-08.05.23* | CHF | 7 175 000 | | 7 175 000 | | | |
| SGS SA-REG-S 0.45000% 20-06.11.23* | CHF | 130 000 | | 130 000 | | | |
| SGS SA-REG-S 1.25000% 22-05.09.25* | CHF | 4 450 000 | | | 4 450 000 | 4 435 760 | 0,41 |
| SGS SA-REG-S 1.75000% 14-27.02.24* | CHF | 1 985 000 | | 1 985 000 | | | |
| SPAREBANK 1 SMN 0.35000% 16-05.04.23* | CHF | 230 000 | | 230 000 | | | |
| SPITAL MAENNEDORF AG-REG-S 0.95000% 18-12.12.23* | CHF | 2 400 000 | | 2 400 000 | | | |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 20-03.10.23* | CHF | 385 000 | | 385 000 | | | |
| SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23* | CHF | 21 465 000 | | 21 465 000 | | | |
| SULZER AG-REG-S 1.60000% 18-22.10.24* | CHF | 2 630 000 | 3 900 000 | | 6 530 000 | 6 512 369 | 0,60 |
| SWISS LIFE HOLDING AG 1.87500% 13-21.06.23* | CHF | 940 000 | | 940 000 | | | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.04000% 23-26.01.26* | CHF | 5 770 000 | | | 5 770 000 | 5 833 470 | 0,54 |
| SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 2.00000% 14-10.12.24* | CHF | | 6 080 000 | | 6 080 000 | 6 099 456 | 0,56 |
| SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24* | CHF | 8 640 000 | 10 070 000 | | 18 710 000 | 18 681 935 | 1,72 |
| SWISS REINSURANCE CO LTD-REG-S 1.00000% 14-17.09.24* | CHF | 250 000 | | | 250 000 | 249 400 | 0,02 |
| SWISSGRID AG-REG-S 1.62500% 13-30.01.25* | CHF | | 2 655 000 | | 2 655 000 | 2 659 248 | 0,25 |
| SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23* | CHF | 9 385 000 | | 9 385 000 | | | |
| SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24* | CHF | 6 000 000 | | | 6 000 000 | 5 968 200 | 0,55 |
| VISECA PAYMENT SERVICES AG 2.25000% 23-27.10.26* | CHF | | 25 000 000 | | 25 000 000 | 25 462 500 | 2,35 |
| VP BANK AG-REG-S 0.87500% 15-07.10.24* | CHF | | 4 885 000 | | 4 885 000 | 4 863 995 | 0,45 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| ZUG ESTATES HOLDING AG-REG-S 0.10000% 19-02.10.25* | CHF | 830 000 | | | 830 000 | 811 325 | 0,07 | |
| ZURICH INSURANCE CO-REG-S 1.87500% 13-18.09.23* | CHF | 150 000 | | 150 000 | | | | |
| ZURICH INSURANCE CO-REG-S 0.50000% 18-18.12.24* | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | |
| TOTAL CHF | | | | | | 542 041 663 | 49,94 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 542 041 663 | 49,94 | |

Anleihen, Nullcoupon

CHF

| | | | | | | | | |
|---|-----|------------|-----------|------------|-----------|----------------------|--------------|--|
| KOREA GAS CORP-REG-S 0.00000% 19-28.11.23* | CHF | 17 965 000 | 2 000 000 | 19 965 000 | | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24* | CHF | 200 000 | 3 640 000 | | 3 840 000 | 3 821 184 | 0,35 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-14.06.24* | CHF | 8 250 000 | 1 250 000 | | 9 500 000 | 9 471 500 | 0,87 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 19-23.06.25* | CHF | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 2 460 250 | 0,23 | |
| PSP SWISS PROPERTY AG 0.00000% 16-01.09.23* | CHF | 14 600 000 | 2 810 000 | 17 410 000 | | | | |
| TOTAL CHF | | | | | | 15 752 934 | 1,45 | |
| Total Anleihen, Nullcoupon | | | | | | 15 752 934 | 1,45 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 1 036 456 072 | 95,50 | |

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

Medium-Term Notes, fester Zins

CHF

| | | | | | | | | |
|---|-----|------------|--|--|------------|----------------------|---------------|--|
| EMIRATES NBD BANK PJSC 0.17000% 21-08.11.24** | CHF | 30 000 000 | | | 30 000 000 | 29 659 800 | 2,74 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 29 659 800 | 2,74 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 29 659 800 | 2,74 | |
| Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden | | | | | | 29 659 800 | 2,74 | |
| Total Wertschriften | | | | | | 1 066 115 872 | 98,24 | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | 0,00 | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 9 776 902 | 0,90 | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | 671 438 | 0,06 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 8 717 974 | 0,80 | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 1 085 282 186 | 100,00 | |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | | -10 752 507 | | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | | -10 292 | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | | 1 074 519 387 | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 1 036 456 072 | 95,50 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | 30 331 238 | 2,80 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 1 066 787 310 | 98,30 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

| Instrument | Nominal | Wahrung | Gebundene Basiswerte in Obligationen/ Aktien in CHF | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|--|-------------|----------|---|----------------------------------|-----------------------|
| Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps | | | | | |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY -0.45800% 21-25.10.24** | 100 000 000 | CHF | 100 000 000 | 1 950 180 | 0.18 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 21-25.10.24 | 100 000 000 | CHF | | | |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.34000% 22-24.06.25** | 150 000 000 | CHF | 150 000 000 | 37 455 | 0.00 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 22-24.06.25 | 150 000 000 | CHF | | | |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.52200% 23-06.01.26** | 100 000 000 | CHF | 100 000 000 | -763 390 | -0.07 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-06.01.26 | 100 000 000 | CHF | | | |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.92400% 23-06.04.25** | 50 000 000 | CHF | 50 000 000 | -520 965 | -0.05 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-06.04.25 | 50 000 000 | CHF | | | |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.15250% 24-03.01.26** | 180 000 000 | CHF | 180 000 000 | -31 842 | 0.00 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 24-03.01.26 | 180 000 000 | CHF | | | |
| | | | 580 000 000 | 671 438 | 0.06 |

Obige Angaben konnen Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Wahrend der Berichtsperiode getatigte engagementreduzierende Derivate

| Instrument | Wahrung | Kaufe/ Kontrakte | Verkaufe/ Kontrakte |
|--|----------|----------------------|-------------------------|
| Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps | | | |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.92400% 23-06.04.25 | CHF | 50 000 000 | 50 000 000 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 23-06.04.25 | CHF | 50 000 000 | 50 000 000 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP PAY 1.15250% 24-03.01.26 | CHF | 180 000 000 | 180 000 000 |
| UBS/INTEREST RATE SWAP REC SARON O/N 24-03.01.26 | CHF | 180 000 000 | 180 000 000 |

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

| Position | Betrag in CHF | in % des Nettofonds- vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Brutto Gesamtengagement aus Derivaten | 575 920 117,33 | 53,60 |
| Netto Gesamtengagement aus Derivaten | – | – |
| Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften | – | – |

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.
Auszahlung in Effekten statt in bar

Auszahlung in Effekten statt in bar

UBS (CH) Institutional Fund 3
– Bonds CHF Short Term II Klasse I-X
Während der Berichtsperiode wurden Effekten (statt in bar)
im Gegenwert von 6 711 100,78 CHF ausgezahlt, was
6 933,6000 Anteilen entspricht.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

| | |
|--|-------|
| <i>UBS (CH) Institutional Fund 3</i> <i>– Bonds CHF Short Term II</i> | |
| <i>Klasse I-A1</i> | 0,21% |
| <i>Klasse I-B</i> | 0,04% |
| <i>Klasse I-X</i> | 0,00% |

Ausgabe- und Rücknahmepreis

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

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurs

EUR 1 = CHF 0.97

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|-------------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 424 505 969.28 | 360 046 512.54 | 451 921 932.92 |
| Klasse I-X | CH0232004017 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 960.89 | 930.88 | 959.09 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 441 783,1410 | 386 782,4600 | 471 199,0150 |

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-X | CHF | 3.8% | -2.7% | -2.5% |
| Benchmark: | | | | |
| SBI® Domestic AAA-BBB 1-5 Jahre (TR) | CHF | 3.6% | -2.7% | -2.5% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------------|--------------|
| Schweiz | 94,87 |
| Vereinigte Staaten | 1,44 |
| Liechtenstein | 0,71 |
| Supranational | 0,46 |
| Italien | 0,37 |
| TOTAL | 97,85 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 6 125 033.12 | 6 179 007.20 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 420 126 067.14 | 356 982 737.62 |
| Sonstige Vermögenswerte | 3 083 709.30 | 2 116 207.72 |
| Gesamtfondsvermögen | 429 334 809.56 | 365 277 952.54 |
| Aufgenommene Kredite | -4 828 840.28 | -5 231 440.00 |
| Nettofondsvermögen | 424 505 969.28 | 360 046 512.54 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 28 929.68 | 1 457.70 |
| Negativzinsen | -8 053.45 | -15 034.65 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 3 614 912.15 | 2 964 564.31 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 364 957.95 | 156 215.35 |
| TOTAL Ertrag | 4 000 746.33 | 3 107 202.71 |
| Aufwand | | |
| Prüfaufwand | -12 530.90 | -12 530.90 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | 0.00 | 0.00 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -10 084.98 | -10 834.74 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -70 497.34 | -343 089.38 |
| TOTAL Aufwand | -93 113.22 | -366 455.02 |
| Nettoertrag | 3 907 633.11 | 2 740 747.69 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -2 792 573.02 | -7 976 628.55 |
| Realisierter Erfolg | 1 115 060.09 | -5 235 880.86 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 13 366 049.42 | -6 445 195.05 |
| Gesamterfolg | 14 481 109.51 | -11 681 075.91 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|--|--------------------|---------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 3 907 633.11 | 2 740 747.69 |
| Zwischenthesaurierung ¹ | -3 101 684.15 | 0.00 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 805 948.96 | 2 740 747.69 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer | 0.00 | -959 261.69 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | 0.00 | -1 781 486.00 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 805 948.96 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 360 046 512.54 | 451 921 932.92 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -2 066 316.20 | -1 095 197.27 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | 52 044 663.43 | -79 099 147.20 |
| Gesamterfolg | 14 481 109.51 | -11 681 075.91 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 424 505 969.28 | 360 046 512.54 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 386 782,4600 | 471 199,0150 |
| Ausgegebene Anteile | 73 823,6920 | 52 048,7750 |
| Zurückgenommene Anteile | -18 823,0110 | -136 465,3300 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 441 783,1410 | 386 782,4600 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 55 000,6810 | -84 416,5550 |

¹ Zwischenthesaurierung:

Klasse I-X: Zwischenthesaurierung (Brutto 7.069 / Ex-Datum 25.3.2024 / Valuta 27.3.2024)

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Aufgrund der Vereinigung des Teilvermögens mit UBS (CH) Investment Fund – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive, per 26. April 2024, wird die Thesaurierung im aufnehmenden Teilvermögen vorgenommen.

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Asset Backed Securities, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| AUTO LEASE-NOW 2023-1 AG-REG-S STEP-UP/DOWN 23-23.02.32* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 0,12 | |
| AUTO LEASE-NOW 2023-2 AG-REG-S STEP-UP/DOWN 23-22.02.33* | CHF | | 1 250 000 | | 1 250 000 | 0,30 | |
| FIRST SWISS MOBILITY-REG-S STEP-UP/DOWN 23-15.05.32* | CHF | 430 000 | | | 430 000 | 0,10 | |
| SWISS CREDIT CARD ISSUANCE-REG-S 2.915000% 23-15.06.28* | CHF | | 350 000 | | 350 000 | 0,08 | |
| SWISSCARD AEC S GMBH-REG-S 0.350000% 21-15.06.26* | CHF | 375 000 | | 375 000 | | | |
| TOTAL CHF | | | | | 2 577 491 | 0,60 | |
| Total Asset Backed Securities, fester Zins | | | | | 2 577 491 | 0,60 | |

Notes, fester Zins

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|-----------|-------------------|-------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| ABB LTD 0.750000% 22-25.03.27* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 0,19 | |
| AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEILIG-REG-S 1.450000% 20-23.07.27* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 0,09 | |
| AMAG LEASING AG 2.750000% 24-12.02.29* | CHF | | 950 000 | | 950 000 | 0,23 | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 3.085000% 23-10.02.28* | CHF | 750 000 | | | 750 000 | 0,18 | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 3.012500% 23-04.09.29* | CHF | | 750 000 | | 750 000 | 0,18 | |
| AXPO HOLDING AG-REG-S 0.625000% 22-04.02.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 0,11 | |
| AXPO HOLDING AG-REG-S 2.000000% 22-15.09.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 0,12 | |
| AXPO HOLDING AG-REG-S 2.500000% 23-22.09.26* | CHF | | 450 000 | | 450 000 | 0,11 | |
| BARRY CALLEBAUT AG 1.950000% 24-24.01.28* | CHF | | 480 000 | | 480 000 | 0,11 | |
| CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 2.411300% 23-08.08.29* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 0,12 | |
| FERRING HOLDING SA-REG-S 2.700000% 23-21.04.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 0,12 | |
| HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG 1.770000% 22-30.10.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 0,12 | |
| HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 3.130000% 23-16.02.29* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 0,24 | |
| INVESTIS HOLDING SA-REG-S 0.250000% 21-14.02.25* | CHF | 1 070 000 | | | 1 070 000 | 0,25 | |
| LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.350000% 20-22.09.26* | CHF | 1 530 000 | | | 1 530 000 | 0,35 | |
| LUZERNER KANTONALBANK AG-REG-S 0.250000% 22-24.01.30* | CHF | | 1 935 000 | | 1 935 000 | 0,42 | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.375000% 12-20.09.29* | CHF | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 0,59 | |
| PFANDBRIEFBK SCHZ HYPO INST-REG-S 0.375000% 18-10.07.28* | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 0,45 | |
| PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZE-REG-S 1.700000% 23-24.07.28* | CHF | | 1 500 000 | | 1 500 000 | 0,36 | |
| PSP SWISS PROPRTY-REG-S 2.250000% 23-02.10.28* | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 0,48 | |
| ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.500000% 22-25.02.27* | CHF | 2 910 000 | | | 2 910 000 | 0,66 | |
| SGS SA-REG-S 2.000000% 23-17.11.27* | CHF | | 900 000 | | 900 000 | 0,21 | |
| SIKA AG 2.250000% 23-13.04.29* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 0,24 | |
| SIKA AG-REG-S 2.350000% 22-28.11.28* | CHF | 300 000 | | | 300 000 | 0,07 | |
| SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.500000% 20-06.10.25* | CHF | 1 120 000 | | | 1 120 000 | 0,26 | |
| SULZER AG-REG-S 0.800000% 20-23.09.25* | CHF | 430 000 | | | 430 000 | 0,10 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 2.258800% 23-26.07.28* | CHF | 420 000 | | | 420 000 | 0,10 | |
| SWISS PRIME SITE FINANCE AG 1.800000% 24-01.03.30* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 0,09 | |
| SWISSCOM AG-REG-S 1.750000% 12-10.07.24* | CHF | 3 655 000 | | 3 650 000 | 5 000 | 0,00 | |
| TECAN GROUP AG-REG-S 0.050000% 21-06.10.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 0,11 | |
| UBS GROUP AG-REG-S 0.435000% 21-09.11.28* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 0,22 | |
| WALLISER KANTONALBANK-REG-S 2.050000% 23-24.07.28* | CHF | 2 500 000 | 1 000 000 | | 3 500 000 | 0,84 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK 1.400000% 22-25.07.29* | CHF | 2 375 000 | | | 2 375 000 | 0,56 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.750000% 23-19.04.28* | CHF | | 1 500 000 | | 1 500 000 | 0,36 | |
| ZUGER KANTONALBANK AG 1.200000% 22-02.06.28* | CHF | 3 500 000 | | | 3 500 000 | 0,81 | |
| TOTAL CHF | | | | | 40 553 419 | 9,45 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | 40 553 419 | 9,45 | |

Notes, Nullcoupon

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|--|--|------------------|-------------|--|
| CHF | | | | | | | |
| CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.000000% 20-31.07.25* | CHF | 4 865 000 | | | 4 865 000 | 1,11 | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.000000% 19-30.03.26* | CHF | 3 170 000 | | | 3 170 000 | 0,72 | |
| TOTAL CHF | | | | | 7 851 153 | 1,83 | |
| Total Notes, Nullcoupon | | | | | 7 851 153 | 1,83 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| ADECCO SA-REG-S 0.87500% 20-27.11.25* | CHF | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 584 800 | 0,37 | |
| ADECCO SA-REG-S 2.37750% 22-17.11.27* | CHF | 460 000 | | 460 000 | 471 040 | 0,11 | |
| BASELLÄNDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.37500% 18-23.03.26* | CHF | 850 000 | | 850 000 | 833 425 | 0,19 | |
| CORNER BANCA SA 2.05000% 23-26.09.28* | CHF | | 800 000 | 800 000 | 813 200 | 0,19 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG 1.00000% 15-14.04.23* | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | |
| CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 2.45860% 23-22.11.24* | CHF | 200 000 | | 200 000 | 201 300 | 0,05 | |
| HOLCIM HELVETIA FINANCE AG-REG-S 0.37500% 22-19.10.26* | CHF | | 680 000 | 680 000 | 660 960 | 0,15 | |
| LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.35000% 18-05.02.27* | CHF | 1 070 000 | | 1 070 000 | 1 041 110 | 0,24 | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.25000% 17-12.10.27* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | 965 200 | 0,22 | |
| RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.177500% 21-15.01.27* | CHF | 500 000 | | 500 000 | 481 250 | 0,11 | |
| SWISS REINSURANCE CO LTD-REG-S 0.75000% 15-21.01.27* | CHF | 850 000 | | 850 000 | 837 250 | 0,20 | |
| UBS GROUP AG-REG-S 0.87500% 19-30.01.25* | CHF | 1 600 000 | | 1 600 000 | | | |
| TOTAL CHF | | | | | 7 889 535 | 1,84 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | 7 889 535 | 1,84 | |
| Medium-Term Notes, Nullcoupon | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24* | CHF | 720 000 | | 720 000 | 712 512 | 0,17 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-06.06.25* | CHF | 1 620 000 | | 1 220 000 | 1 199 382 | 0,28 | |
| TOTAL CHF | | | | | 1 911 894 | 0,45 | |
| Total Medium-Term Notes, Nullcoupon | | | | | 1 911 894 | 0,45 | |
| Anleihen, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.06000% 16-01.07.25* | CHF | 2 570 000 | | 2 570 000 | 2 526 567 | 0,59 | |
| AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02000% 16-17.10.24* | CHF | 1 070 000 | | 1 070 000 | | | |
| AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.25000% 17-07.09.26* | CHF | 250 000 | | 250 000 | 243 250 | 0,06 | |
| AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.25000% 18-03.04.25* | CHF | 850 000 | | 850 000 | 840 055 | 0,20 | |
| AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 19-11.02.26* | CHF | 565 000 | | 565 000 | 552 288 | 0,13 | |
| ABB LTD 1.97750% 23-22.09.28* | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | 2 046 000 | 0,48 | |
| ABB LTD-REG-S 0.30000% 19-06.08.24* | CHF | 640 000 | | 640 000 | 636 928 | 0,15 | |
| AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 2.20000% 22-22.09.26* | CHF | 600 000 | | 600 000 | 608 700 | 0,14 | |
| ALLREAL HOLDING AG 0.62500% 16-10.05.24* | CHF | 1 710 000 | | 1 710 000 | | | |
| ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.75000% 17-19.06.26* | CHF | 1 300 000 | | 1 300 000 | 1 272 700 | 0,30 | |
| ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.70000% 20-22.09.28* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | 957 000 | 0,22 | |
| ALPIQ HOLDING AG 1.75000% 22-24.06.26* | CHF | 750 000 | | 750 000 | 748 875 | 0,17 | |
| ALPIQ HOLDING AG-REG-S 2.62500% 14-29.07.24* | CHF | 250 000 | | 250 000 | | | |
| AMAG LEASING AG 0.17500% 21-16.06.25* | CHF | 735 000 | | 735 000 | 719 565 | 0,17 | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.87500% 17-25.10.24* | CHF | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 987 400 | 0,46 | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.52500% 21-27.10.26* | CHF | 930 000 | | 930 000 | 897 915 | 0,21 | |
| AMAG LEASING AG-REG-S 2.20000% 23-22.11.27* | CHF | | 1 250 000 | 1 250 000 | 1 273 750 | 0,30 | |
| AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| AXPO HOLDING AG-REG-S 3.12500% 10-26.02.25* | CHF | 2 750 000 | | 2 750 000 | 2 787 125 | 0,65 | |
| BALOISE HOLDING AG-REG-S 1.12500% 14-19.12.24* | CHF | 1 070 000 | | 1 070 000 | 1 066 897 | 0,25 | |
| BALOISE HOLDING-REG-S 0.25000% 20-16.12.26* | CHF | 850 000 | | 850 000 | 823 225 | 0,19 | |
| BANCA DELLO STATO CANTONE TICINO-REG-S 0.37500% 18-08.02.28* | CHF | 2 105 000 | | 2 105 000 | 2 019 748 | 0,47 | |
| BANK CLER AG-REG-S 0.37500% 19-26.04.27* | CHF | 1 280 000 | | 1 280 000 | 1 232 640 | 0,29 | |
| BANK JULIUS BAER & CO AG 2.50000% 23-06.09.30* | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | 2 060 000 | 0,48 | |
| BANQUE CANTONALE NEUCHATELOISE 2.05000% 23-24.05.28* | CHF | | 800 000 | 800 000 | 819 600 | 0,19 | |
| BASELLÄNDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 1.75000% 11-22.11.24* | CHF | 2 570 000 | | 2 570 000 | 2 573 598 | 0,60 | |
| BASELLÄNDSCHAFTLICHE KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 15-13.05.25* | CHF | 1 280 000 | | 1 280 000 | 1 263 104 | 0,29 | |
| BASELLÄNDSCHAFTLICHE KANTONALBANK-REG-S 0.01000% 22-28.07.26* | CHF | 850 000 | | 850 000 | 823 650 | 0,19 | |
| BASLER KANTONALBANK 1.50000% 12-02.03.27* | CHF | 2 140 000 | | 2 140 000 | 2 149 630 | 0,50 | |
| BELL FOOD GROUP AG-REG-S 1.55000% 22-16.05.29* | CHF | | 2 000 000 | 2 000 000 | 1 985 000 | 0,46 | |
| BERN, CANTON OF 1.25000% 12-30.03.27* | CHF | 3 000 000 | | 3 000 000 | 3 009 000 | 0,70 | |
| BERN, CANTON OF-REG-S 1.75000% 10-24.09.25* | CHF | 640 000 | | 640 000 | 644 800 | 0,15 | |
| BOBST GROUP SA 2.54500% 24-31.01.29* | CHF | | 550 000 | 550 000 | 557 975 | 0,13 | |
| BOBST GROUP SA-REG-S 0.50000% 20-17.02.26* | CHF | 625 000 | | 625 000 | 611 563 | 0,14 | |
| CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.37500% 17-27.06.25* | CHF | 640 000 | | 640 000 | 630 976 | 0,15 | |
| CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.25000% 17-23.05.24* | CHF | 1 710 000 | | 1 710 000 | | | |
| CEMBRA MONEY BANK AG 2.53850% 23-05.04.29* | CHF | | 400 000 | 400 000 | 414 000 | 0,10 | |
| CEMBRA MONEY BANK AG 2.21500% 24-05.02.30* | CHF | | 400 000 | 400 000 | 407 600 | 0,09 | |
| CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.87500% 18-08.06.26* | CHF | 2 140 000 | | 2 140 000 | 2 105 760 | 0,49 | |
| COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.87500% 15-31.07.24* | CHF | 1 450 000 | | 1 450 000 | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26* | CHF | 1 375 000 | | | 1 375 000 | 1 346 813 | 0,31 |
| CREDIT AGRICOLE NEXT BANK SUISSE-REG-S 1.46250% 24-25.03.27* | CHF | | 1 500 000 | | 1 500 000 | 1 502 250 | 0,35 |
| CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 1.87500% 22-29.06.26* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 007 000 | 0,23 |
| DORMAKABA FINANCE AG-REG-S 1.00000% 17-13.10.25* | CHF | 1 070 000 | | 1 070 000 | | | |
| DORMAKABA FINANCE AG-REG-S 3.75000% 22-14.10.27* | CHF | | 1 070 000 | | 1 070 000 | 1 132 060 | 0,26 |
| EMISSIONS- UND FINANZ AG-REG-S 0.37500% 21-06.05.26* | CHF | 860 000 | | | 860 000 | 832 480 | 0,19 |
| EMISSIONS- UND FINANZ AG-REG-S 2.65000% 23-06.06.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 511 750 | 0,12 |
| EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTR-REG-S 0.12500% 15-27.05.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 839 290 | 0,20 |
| ENERGIEFINANZIERUNGS AG-REG-S 3.45000% 23-06.07.28* | CHF | | 900 000 | | 900 000 | 936 450 | 0,22 |
| EUROFMA EUROPEAN RALRADMAT FIN CO-REG-S 3.00000% 06-15.05.26* | CHF | 1 920 000 | | | 1 920 000 | 1 991 040 | 0,46 |
| FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.05190% 21-20.12.24* | CHF | 1 620 000 | | | 1 620 000 | 1 600 398 | 0,37 |
| FERRING HOLDING SA-REG-S 1.05000% 20-09.07.25* | CHF | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 189 440 | 0,28 |
| FLUGHAFEN ZURICH AG-REG-S 0.62500% 17-24.05.29* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 958 000 | 0,22 |
| FREIBURGER KANTONALBANK 0.55000% 15-03.02.25* | CHF | 8 140 000 | | | 8 140 000 | 8 078 136 | 1,88 |
| FREIBURGER KANTONALBANK 0.30000% 17-17.02.27* | CHF | 1 070 000 | | | 1 070 000 | 1 035 225 | 0,24 |
| FREIBURGER KANTONALBANK 0.20000% 18-20.02.26* | CHF | 1 205 000 | | | 1 205 000 | 1 176 683 | 0,27 |
| GALÉNICA AG-REG-S 2.35000% 23-08.11.29* | CHF | | 750 000 | | 750 000 | 778 500 | 0,18 |
| GEBERT AG 0.75000% 22-29.09.27* | CHF | 305 000 | | | 305 000 | 298 748 | 0,07 |
| GEBERT AG-REG-S 0.10000% 19-17.10.24* | CHF | 1 710 000 | | 1 710 000 | | | |
| GENEVA, CANTON OF-REG-S 2.25000% 13-20.09.29* | CHF | | 670 000 | | 670 000 | 707 520 | 0,16 |
| GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.02000% 15-27.11.24* | CHF | 2 570 000 | | 2 570 000 | | | |
| GIVAUDAN FINANCE SA-REG-S 0.12500% 21-07.06.27* | CHF | 160 000 | | | 160 000 | 153 440 | 0,04 |
| GIVAUDAN SA-REG-S 1.62500% 22-15.06.29* | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 2 013 000 | 0,47 |
| GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.37500% 15-26.02.27* | CHF | 1 710 000 | | | 1 710 000 | 1 662 120 | 0,39 |
| GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 17-26.09.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 833 510 | 0,19 |
| GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.40000% 18-30.11.26* | CHF | 1 255 000 | | | 1 255 000 | 1 221 743 | 0,28 |
| GRANDE DIXENCE SA-REG-S 0.80000% 19-17.06.26* | CHF | 980 000 | | | 980 000 | 962 360 | 0,22 |
| GZO AG SPITAL WETZIKON-REG-S 1.87500% 14-12.06.24* | CHF | 960 000 | | | 960 000 | 957 984 | 0,22 |
| HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 0.87500% 19-08.05.24* | CHF | 850 000 | | 850 000 | | | |
| HILTI AG-REG-S 0.05000% 20-02.07.25* | CHF | 1 710 000 | | | 1 710 000 | 1 680 930 | 0,39 |
| INTERSHOP HOLDING AG-REG-S 0.30000% 21-29.06.26* | CHF | 865 000 | | | 865 000 | 835 158 | 0,19 |
| JULIUS BAER GROUP-REG-S 0.37500% 17-06.12.24* | CHF | 1 280 000 | | | 1 280 000 | 1 267 328 | 0,30 |
| KERNKRAFTWERK GOESGEN-DAENIKEN-REG-S 0.93000% 20-30.09.27* | CHF | 1 240 000 | | | 1 240 000 | 1 196 600 | 0,28 |
| KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 1.25000% 14-11.09.24* | CHF | 3 640 000 | | | 3 640 000 | 3 632 356 | 0,85 |
| KRAFTWERKE OBERHASLI AG-REG-S 1.87500% 13-21.02.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 501 550 | 0,12 |
| KRAFTWERKE OBERHASLI AG 0.70000% 17-30.01.26* | CHF | 1 580 000 | | | 1 580 000 | 1 561 040 | 0,36 |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 1.00000% 15-04.12.25* | CHF | 680 000 | | 680 000 | | | |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 1.00000% 18-11.12.24* | CHF | 2 570 000 | | | 2 570 000 | 2 561 005 | 0,60 |
| LGT BANK AG-REG-S 0.50000% 17-12.05.27* | CHF | | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 359 400 | 0,32 |
| LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 2.10000% 23-12.09.29* | CHF | 350 000 | 850 000 | | 1 200 000 | 1 219 200 | 0,28 |
| LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 2.10000% 23-12.09.29* | CHF | | 850 000 | 850 000 | | | |
| LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 3.00000% 05-11.03.25* | CHF | 2 570 000 | | | 2 570 000 | 2 607 265 | 0,61 |
| MIGROS BANK AG-REG-S 2.25000% 23-26.09.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 411 000 | 0,10 |
| MOBIMO HOLDING AG-REG-S 1.87500% 14-16.09.24* | CHF | 1 070 000 | | 1 070 000 | | | |
| MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 20-23.03.28* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 945 500 | 0,22 |
| MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 21-19.03.27* | CHF | 2 140 000 | | | 2 140 000 | 2 053 330 | 0,48 |
| NANT DE DRANCE SA-REG-S 2.00000% 16-02.02.26* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 857 225 | 0,20 |
| NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.55000% 18-19.08.25* | CHF | 2 570 000 | | | 2 570 000 | 2 570 000 | 0,60 |
| NANT DE DRANCE SA-REG-S 1.25000% 20-25.06.27* | CHF | 1 875 000 | | | 1 875 000 | 1 858 125 | 0,43 |
| NESTLE SA 1.87500% 23-28.06.29* | CHF | | 6 000 000 | | 6 000 000 | 6 168 000 | 1,44 |
| NESTLE SA-REG-S 0.25000% 18-28.06.24* | CHF | 3 420 000 | | 3 420 000 | | | |
| NOVARTIS AG-REG-S 0.25000% 15-13.05.25* | CHF | 2 140 000 | | 285 000 | 1 855 000 | 1 833 482 | 0,43 |
| OC OERLIKON CORP AG-REG-S 2.62500% 14-17.06.24* | CHF | 955 000 | | 955 000 | | | |
| OC OERLIKON CORP AG-REG-S 0.37500% 21-27.11.25* | CHF | 810 000 | | | 810 000 | 787 320 | 0,18 |
| OC OERLIKON CORP INC, PFAEFF-REG-S 2.87500% 23-02.06.26* | CHF | | 350 000 | | 350 000 | 354 025 | 0,08 |
| PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 3.25000% 07-15.06.27* | CHF | 1 710 000 | | | 1 710 000 | 1 816 362 | 0,42 |
| PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 2.12500% 10-01.12.28* | CHF | 4 710 000 | | | 4 710 000 | 4 892 748 | 1,14 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER-REG-S 0.25000% 22-15.03.27* | CHF | 1 710 000 | | | 1 710 000 | 1 660 239 | 0,39 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HY-REG-S 1.00000% 22-06.09.30* | CHF | | 840 000 | | 840 000 | 825 132 | 0,19 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER-REG-S 1.25000% 24-28.05.30* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 998 000 | 0,23 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPOTH 1.75000% 24-22.03.29* | CHF | 4 000 000 | 4 000 000 | | | | |
| PFANDBREFBK SCHWR HYP-REG-S 1.75000% 23-22.03.29* | CHF | 1 000 000 | 12 000 000 | | 13 000 000 | 13 300 300 | 3,10 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 2.37500% 11-27.06.25* | CHF | 3 640 000 | | | 3 640 000 | 3 686 956 | 0,86 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZ HYPO INST-REG-S 1.75000% 13-15.07.25* | CHF | 2 140 000 | | | 2 140 000 | 2 151 770 | 0,50 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 14-23.08.24* | CHF | 850 000 | | 850 000 | | | |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 14-19.03.25* | CHF | 7 280 000 | | 3 000 000 | 4 280 000 | 4 249 612 | 0,99 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 15-24.01.25* | CHF | 3 420 000 | | | 3 420 000 | 3 394 692 | 0,79 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 15-15.10.25* | CHF | 1 070 000 | | | 1 070 000 | 1 055 020 | 0,25 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYO-REG-S 0.12500% 16-06.09.28* | CHF | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 901 800 | 0,44 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZER HYPO INST-REG-S 0.12500% 16-15.12.27* | CHF | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 2 877 000 | 0,67 |
| PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 17-06.05.25* | CHF | 2 140 000 | | | 2 140 000 | 2 111 966 | 0,49 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-18.01.27* | CHF | 2 570 000 | | | 2 570 000 | 2 498 811 | 0,58 | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERIS HYP INST-REG-S 0.50000% 18-22.01.29* | CHF | | 10 000 000 | | 10 000 000 | 9 641 000 | 2,25 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.50000% 12-21.05.29* | CHF | | 820 000 | | 820 000 | 829 676 | 0,19 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.62500% 14-17.06.26* | CHF | 5 140 000 | | | 5 140 000 | 5 179 578 | 1,21 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.00000% 14-22.09.28* | CHF | 3 500 000 | | | 3 500 000 | 3 461 150 | 0,81 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.62500% 15-12.02.30* | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 4 815 000 | 1,12 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 15-28.07.25* | CHF | 5 570 000 | | | 5 570 000 | 5 511 515 | 1,28 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.37500% 15-15.09.25* | CHF | 3 210 000 | | | 3 210 000 | 3 167 307 | 0,74 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 15-17.07.24* | CHF | 5 150 000 | | 5 150 000 | | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.12500% 15-25.02.26* | CHF | 1 280 000 | | | 1 280 000 | 1 252 352 | 0,29 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.25000% 16-21.05.25* | CHF | 5 140 000 | | | 5 140 000 | 5 079 348 | 1,18 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 16-02.12.24* | CHF | 6 850 000 | | | 6 850 000 | 6 789 720 | 1,58 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 17-12.10.29* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 959 700 | 0,22 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.25000% 17-26.05.27* | CHF | 2 780 000 | | | 2 780 000 | 2 694 098 | 0,63 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.25000% 17-12.05.26* | CHF | 1 070 000 | | | 1 070 000 | 1 047 316 | 0,24 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 18-16.04.25* | CHF | 3 080 000 | | | 3 080 000 | 3 041 808 | 0,71 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 18-31.10.24* | CHF | 9 140 000 | | 9 140 000 | | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.30000% 19-09.04.29* | CHF | | 7 000 000 | | 7 000 000 | 6 674 500 | 1,55 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALB-REG-S 1.10000% 22-18.04.28* | CHF | 4 000 000 | | | 4 000 000 | 3 975 600 | 0,93 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBK-REG-S 1.80000% 23-10.09.29* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 027 800 | 0,24 | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHZ KANTLBKEN-REG-S 0.50000% 18-19.05.28* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 484 850 | 0,11 | |
| PFNBFRZNRLE SCHWIZIN KNTNLBNKN AG-REG-S 1.50000% 22-17.12.29* | CHF | 6 000 000 | | | 6 000 000 | 6 073 800 | 1,41 | |
| RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.18250% 20-11.11.25* | CHF | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 477 500 | 0,34 | |
| RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 2.11250% 23-28.09.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 021 500 | 0,24 | |
| ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.10000% 17-23.09.24* | CHF | 1 710 000 | | 1 710 000 | | | | |
| ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.45000% 17-23.03.29* | CHF | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 443 000 | 0,34 | |
| SANDOZ GROUP AG-REG-S 2.12500% 23-17.11.26* | CHF | | 820 000 | | 820 000 | 832 300 | 0,19 | |
| SCHAFFHAUSER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 18-31.05.28* | CHF | 745 000 | | | 745 000 | 718 553 | 0,17 | |
| SCHWEIZER VERBAND DER RAIFFEISENBANKEN 0.40500% 21-28.09.29* | CHF | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 2 325 000 | 0,54 | |
| SCHWYZER KANTONALBANK 0.25000% 16-19.02.26* | CHF | 1 280 000 | | | 1 280 000 | 1 252 480 | 0,29 | |
| SCHWYZER KANTONALBANK 0.10000% 16-25.10.28* | CHF | | 1 725 000 | | 1 725 000 | 1 624 950 | 0,38 | |
| SGS SA-REG-S 0.95000% 20-06.11.26* | CHF | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 479 000 | 0,34 | |
| SGS SA-REG-S 1.25000% 22-05.09.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 498 400 | 0,12 | |
| SIKA AG-REG-S 0.62500% 18-12.07.24* | CHF | 850 000 | | 850 000 | | | | |
| SIX GROUP AG-REG-S 0.12500% 21-27.11.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 481 865 | 0,11 | |
| ST GALLER KANTONALBANK 1.37500% 12-22.06.27* | CHF | 310 000 | | | 310 000 | 310 310 | 0,07 | |
| ST GALLER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 15-24.06.25* | CHF | 1 710 000 | | | 1 710 000 | 1 690 506 | 0,39 | |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-03.10.25* | CHF | 1 620 000 | | | 1 620 000 | 1 595 700 | 0,37 | |
| SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 2.00000% 14-10.12.24* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 501 600 | 0,12 | |
| SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.50000% 16-03.11.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 835 975 | 0,19 | |
| SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27* | CHF | 2 250 000 | | | 2 250 000 | 2 226 375 | 0,52 | |
| SWISSCOM AG-REG-S 0.37500% 17-31.05.27* | CHF | 3 650 000 | | | 3 650 000 | 3 531 375 | 0,82 | |
| SWISSGRID AG-REG-S 1.62500% 13-30.01.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 851 360 | 0,20 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.50000% 13-24.07.25* | CHF | 8 200 000 | | | 8 200 000 | 8 257 400 | 1,92 | |
| SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 14-28.05.26* | CHF | 12 850 000 | | | 12 850 000 | 12 945 090 | 3,02 | |
| SWITZERLAND-REG-S 3.25000% 07-27.06.27* | CHF | 6 280 000 | | | 6 280 000 | 6 756 652 | 1,57 | |
| SWITZERLAND-REG-S 4.00000% 98-08.04.28* | CHF | | 5 000 000 | | 5 000 000 | 5 633 500 | 1,31 | |
| SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 1.25000% 20-16.10.23* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| SYNGENTA FINANCE AG-REG-S 0.62500% 21-30.08.24* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 497 350 | 0,12 | |
| THURGAUER KANTONALBANK 1.50000% 13-04.03.27* | CHF | | 4 000 000 | | 4 000 000 | 4 016 000 | 0,94 | |
| THURGAUER KANTONALBANK 1.75000% 13-30.09.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| THURGAUER KANTONALBANK 0.37500% 15-31.03.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 841 415 | 0,20 | |
| UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 595 200 | 0,14 | |
| UBS SWITZERLAND AG-REG-S 1.82000% 23-18.10.26* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 008 000 | 0,23 | |
| UNION BANCAIRE PRIVÉE UBP SA-REG-S 0.20000% 21-15.12.26* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 816 850 | 0,19 | |
| VALIANT BANK AG 1.85000% 23-31.05.28* | CHF | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 3 028 500 | 0,71 | |
| VALIANT BANK AG-REG-S 0.37500% 17-06.12.27* | CHF | | 1 500 000 | | 1 500 000 | 1 436 250 | 0,33 | |
| VP BANK AG-REG-S 0.87500% 15-07.10.24* | CHF | 640 000 | | 640 000 | | | | |
| WALLISER KANTONALBANK 0.40000% 15-15.09.25* | CHF | 1 280 000 | | | 1 280 000 | 1 260 288 | 0,29 | |
| WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.20000% 17-02.02.26* | CHF | 3 290 000 | | | 3 290 000 | 3 219 265 | 0,75 | |
| WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 19-01.02.27* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 387 400 | 0,09 | |
| WALLISER KANTONALBANK 1.80000% 23-29.08.29* | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 2 046 000 | 0,48 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 16-13.05.26* | CHF | 4 280 000 | | | 4 280 000 | 4 173 000 | 0,97 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.02000% 16-16.08.27* | CHF | 325 000 | | | 325 000 | 310 700 | 0,07 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 16-23.11.26* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 821 100 | 0,19 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 17-27.01.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 490 000 | 0,11 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 18-25.01.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 962 500 | 0,22 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 18-08.05.25* | CHF | 1 690 000 | | | 1 690 000 | 1 668 537 | 0,39 | |
| ZUERCHER KANTONALBANK 0.25000% 22-28.03.28* | CHF | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 395 000 | 0,56 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| ZUERICH, CITY OF-REG-S 2.75000% 05-14.02.25* | CHF | 2 905 000 | | | 2 905 000 | 0,68 | |
| ZURICH INSURANCE CO-REG-S 0.50000% 18-18.12.24* | CHF | 715 000 | | | 715 000 | 0,17 | |
| ZURICH INSURANCE CO-REG-S 1.00000% 18-30.10.28* | CHF | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 0,27 | |
| TOTAL CHF | | | | | 325 502 219 | 75,81 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | 325 502 219 | 75,81 | |

Anleihen, Nullcoupon

CHF

| | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|-----------|-------------------|-------------|------|
| AMAG LEASING AG-REG-S 0.00000% 21-18.02.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 492 650 | 0,11 |
| BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.00000% 19-25.09.26* | CHF | 940 000 | | | 940 000 | 907 100 | 0,21 |
| GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 19-16.10.29* | CHF | | 1 800 000 | | 1 800 000 | 1 667 700 | 0,39 |
| KANTONSSPITAL WINTERTHUR-REG-S 0.00000% 21-30.09.25* | CHF | 250 000 | | | 250 000 | 244 500 | 0,06 |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24* | CHF | 7 280 000 | | 7 280 000 | | | |
| PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-06.04.27* | CHF | 8 000 000 | | | 8 000 000 | 7 703 200 | 1,79 |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-14.06.24* | CHF | 4 570 000 | | 4 570 000 | | | |
| PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 19-23.06.25* | CHF | 4 710 000 | | | 4 710 000 | 4 635 111 | 1,08 |
| SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 16-22.06.29* | CHF | 7 000 000 | | | 7 000 000 | 6 745 900 | 1,57 |
| TESSIN, CANTON OF-REG-S 0.00000% 21-31.03.26* | CHF | 2 570 000 | | | 2 570 000 | 2 505 750 | 0,58 |
| VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.10.25* | CHF | 2 635 000 | | | 2 635 000 | 2 571 760 | 0,60 |
| VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 21-20.01.26* | CHF | 1 710 000 | | | 1 710 000 | 1 660 410 | 0,39 |
| WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-14.02.29* | CHF | | 3 950 000 | | 3 950 000 | 3 691 275 | 0,86 |
| TOTAL CHF | | | | | 32 825 356 | 7,65 | |
| Total Anleihen, Nullcoupon | | | | | 32 825 356 | 7,65 | |

Anleihen, variabler Zins

CHF

| | | | | | | | |
|--|-----|--|-----------|--|--------------------|--------------|---------------|
| ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 2.000%/VAR 24-22.03.30* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 015 000 | 0,23 |
| TOTAL CHF | | | | | 1 015 000 | 0,23 | |
| Total Anleihen, variabler Zins | | | | | 1 015 000 | 0,23 | |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 420 126 067 | 97,85 | |
| Total Wertschriften | | | | | 420 126 067 | 97,85 | |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | 0,00 |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | 6 125 033 | | 1,43 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 3 083 710 | | 0,72 |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | 429 334 810 | | 100,00 |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | -4 828 841 | | |
| Nettofondsvermögen | | | | | 424 505 969 | | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 420 126 067 | 97,85 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | - | - |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | - | - |
| TOTAL | 420 126 067 | 97,85 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

*UBS (CH) Institutional Fund 3
– Bonds CHF Inland Medium Term Passive II
Klasse I-X*

0,01%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 | 31.3.2022 |
|-------------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 211 982 602.14 | 192 207 277.74 | 258 211 087.16 |
| Klasse I-X | CH0232003951 | | | |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 973.85 | 926.48 | 943.70 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 217 674,3640 | 207 459,5380 | 273 614,3710 |

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 | 2021/2022 |
|-------------------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse I-X | CHF | 5.7% | -1.5% | -5.2% |
| Benchmark: | | | | |
| SBI® Foreign AAA-BBB 1-5 Jahre (TR) | CHF | 4.6% | -2.5% | -4.3% |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------------|--------------|
| Frankreich | 16,90 |
| Deutschland | 11,70 |
| Vereinigte Staaten | 10,79 |
| Kanada | 9,43 |
| Supranational | 7,44 |
| Grossbritannien | 5,32 |
| Südkorea | 5,26 |
| Niederlande | 5,06 |
| Australien | 5,01 |
| Chile | 3,53 |
| Übrige | 18,43 |
| TOTAL | 98,87 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Verkehrswerte | | |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 1 170 999.84 | 4 849 582.54 |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 210 279 975.30 | 191 650 923.94 |
| Sonstige Vermögenswerte | 1 231 452.00 | 870 617.99 |
| Gesamtfondsvermögen | 212 682 427.14 | 197 371 124.47 |
| Aufgenommene Kredite | -699 825.00 | -5 163 846.73 |
| Nettofondsvermögen | 211 982 602.14 | 192 207 277.74 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| | CHF | CHF |
| Ertrag | | |
| Erträge der Bankguthaben | 8 601.76 | 1 077.30 |
| Negativzinsen | -3 865.55 | -10 582.50 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 2 052 312.04 | 1 749 495.58 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 211 544.72 | 7 510.50 |
| TOTAL Ertrag | 2 268 592.97 | 1 747 500.88 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | 0.00 | -110.15 |
| Prüfaufwand | -12 530.00 | -13 069.40 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-B | 0.00 | 0.00 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -6 515.81 | -6 273.89 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -72 810.92 | -210 816.68 |
| TOTAL Aufwand | -91 856.73 | -230 270.12 |
| Nettoertrag | 2 176 736.24 | 1 517 230.76 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -4 197 387.79 | -6 373 159.14 |
| Realisierter Erfolg | -2 020 651.55 | -4 855 928.38 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 12 908 794.45 | 560 143.53 |
| Gesamterfolg | 10 888 142.90 | -4 295 784.85 |

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|--------------------|---------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 2 176 736.24 | 1 517 230.76 |
| Zwischenthesaurierung ¹ | -1 925 363.98 | 0.00 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 251 372.26 | 1 517 230.76 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer ² | 0.00 | -531 030.77 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | 0.00 | -986 199.99 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 251 372.26 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 192 207 277.74 | 258 211 087.16 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -1 174 941.77 | -625 124.33 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | 10 062 123.27 | -61 082 900.24 |
| Gesamterfolg | 10 888 142.90 | -4 295 784.85 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 211 982 602.14 | 192 207 277.74 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 1.4.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 207 459,5380 | 273 614,3710 |
| Ausgegebene Anteile | 37 112,7150 | 9 685,1820 |
| Zurückgenommene Anteile | -26 897,8890 | -75 840,0150 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 217 674,3640 | 207 459,5380 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 10 214,8260 | -66 154,8330 |

¹ Zwischenthesaurierung:

Klasse I-X: Zwischenthesaurierung (Brutto 8.893 / Ex-Datum 25.3.2024 / Valuta 27.3.2024)

² resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizilierte Anleger gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs.1 VStV

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung) ohne VSt-Abzug³

Aufgrund der Vereinigung des Teilvermögens mit UBS (CH) Investment Fund – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive, per 3. Mai 2024, wird die Thesaurierung im aufnehmenden Teilvermögen vorgenommen.

³ Dividenden aus Fonds mit direktem Grundbesitz

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Notes, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| AT&T INC-REG-S 1.37500% 14-04.12.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| EQUINIX EUR 1 FINANCING CORP LLC-REG-S 2.87500% 23-12.09.28* | CHF | | 1 265 000 | | 1 265 000 | 1 302 950 | 0,61 |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.62500% 14-04.02.25* | CHF | 1 100 000 | | 1 100 000 | | | |
| ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25* | CHF | 275 000 | | | 275 000 | 272 800 | 0,13 |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26* | CHF | 1 500 000 | | 500 000 | 1 000 000 | 966 000 | 0,45 |
| NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.25000% 15-30.04.25* | CHF | 695 000 | | | 695 000 | 686 382 | 0,32 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-REG-S 1.62500% 14-16.05.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| RZD CAP PLC/RUSS RAIL-REG-S *DEFAULTED* 0.89800% 19-03.10.25* | CHF | 1 400 000 | | 1 400 000 | | | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.65250% 24-07.03.28* | CHF | | 800 000 | | 800 000 | 805 200 | 0,38 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.19250% 21-24.03.28* | CHF | | 1 250 000 | | 1 250 000 | 1 188 125 | 0,56 |
| WURTH FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 2.10000% 22-16.11.26* | CHF | 640 000 | | | 640 000 | 649 920 | 0,31 |
| TOTAL CHF | | | | | | 5 871 377 | 2,76 |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 5 871 377 | 2,76 |
| Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | | |
| CHF | | | | | | | |
| ABN AMRO BANK NV 2.30000% 23-26.06.25* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 404 160 | 0,19 |
| ABN AMRO BANK NV 2.50500% 23-26.06.28* | CHF | | 200 000 | | 200 000 | 206 100 | 0,10 |
| ABN AMRO BANK NV-REG-S 0.30000% 16-18.12.24* | CHF | 415 000 | | 415 000 | | | |
| ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.62500% 23-02.03.28* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 025 000 | 0,48 |
| ACHMEA BANK NV-REG-S 0.50000% 17-03.10.25* | CHF | 450 000 | | | 450 000 | 443 025 | 0,21 |
| ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.72500% 18-15.02.24* | CHF | 465 000 | | 465 000 | | | |
| ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.50000% 19-29.11.24* | CHF | 880 000 | | | 880 000 | 872 608 | 0,41 |
| AFRICA FINANCE CORP-REG-S 0.52250% 19-20.12.23* | CHF | 665 000 | | 665 000 | | | |
| AFRICAN DEVELOPMENT BANK 1.60250% 23-05.07.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 406 800 | 0,19 |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 2.62500% 10-18.02.25* | CHF | 930 000 | | 930 000 | | | |
| AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.25000% 15-17.11.25* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 392 400 | 0,18 |
| ALD SA 2.22500% 24-28.03.29* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 605 400 | 0,28 |
| AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | |
| ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24* | CHF | 100 000 | | 100 000 | | | |
| AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 825 775 | 0,39 |
| AROUNDTOWN SA-REG-S 1.72000% 19-05.03.26* | CHF | 355 000 | | | 355 000 | 341 155 | 0,16 |
| ASB BANK LTD-REG-S 0.20000% 17-02.08.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | |
| ASB BANK LTD-REG-S 0.45000% 19-30.01.25* | CHF | 930 000 | | 930 000 | | | |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.80000% 22-06.07.27* | CHF | 650 000 | | | 650 000 | 644 150 | 0,30 |
| ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.85000% 20-14.10.25* | CHF | 975 000 | | 400 000 | 575 000 | 566 088 | 0,27 |
| ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.50000% 21-15.01.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 575 400 | 0,27 |
| AUCKLAND COUNCIL-REG-S 1.50000% 14-28.11.25* | CHF | 380 000 | | | 380 000 | 381 330 | 0,18 |
| BANCO BICE-REG-S 0.75000% 21-29.10.26* | CHF | 350 000 | | | 350 000 | 334 950 | 0,16 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.40750% 22-28.11.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 506 750 | 0,24 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 2.77000% 22-28.11.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 419 600 | 0,20 |
| BANCO DE CHILE-REG-S 0.31540% 21-04.01.27* | CHF | 890 000 | | | 890 000 | 850 840 | 0,40 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24* | CHF | 650 000 | | 650 000 | | | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.25000% 19-29.10.25* | CHF | 430 000 | | | 430 000 | 419 250 | 0,20 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26* | CHF | 800 000 | | 400 000 | 400 000 | 381 200 | 0,18 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.38500% 21-15.12.26* | CHF | 515 000 | | | 515 000 | 491 825 | 0,23 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27* | CHF | 615 000 | | | 615 000 | 588 555 | 0,28 |
| BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.57500% 17-07.04.27* | CHF | | 800 000 | | 800 000 | 765 200 | 0,36 |
| BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.01000% 19-04.10.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 557 100 | 0,26 |
| BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24* | CHF | 895 000 | | 895 000 | | | |
| BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24* | CHF | 375 000 | | | 375 000 | 372 375 | 0,18 |
| BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.33000% 21-22.06.27* | CHF | 870 000 | | | 870 000 | 822 585 | 0,39 |
| BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 0.29750% 21-22.10.26* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 573 300 | 0,27 |
| BANCO SANTANDER SA 2.39500% 24-16.02.29* | CHF | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 2 040 000 | 0,96 |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24* | CHF | 1 150 000 | | 1 150 000 | | | |
| BANK FUER ARBEIT UN WIRTSCHAFT AG 2.05250% 23-14.04.28* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 610 800 | 0,29 |
| BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26* | CHF | 1 700 000 | | 400 000 | 1 300 000 | 1 266 200 | 0,60 |
| BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.42250% 21-23.11.29* | CHF | | 800 000 | | 800 000 | 747 600 | 0,35 |
| BANK OF MONTREAL-REG-S 2.26000% 23-01.02.29* | CHF | 300 000 | | | 300 000 | 309 450 | 0,15 |
| BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.20000% 18-19.11.25* | CHF | 2 940 000 | | 400 000 | 2 540 000 | 2 489 200 | 1,17 |
| BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 0.27800% 22-01.04.27* | CHF | 900 000 | | | 900 000 | 870 750 | 0,41 |
| BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.04250% 23-04.05.26* | CHF | | 1 800 000 | 800 000 | 1 000 000 | 1 013 500 | 0,48 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|---------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | in CHF | in % ³ | |
| BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.38250% 23-22.09.27* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 718 900 | 0,34 | |
| BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.25000% 19-10.07.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 492 200 | 0,23 | |
| BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 19-12.06.26* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 388 400 | 0,18 | |
| BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 20-03.11.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 936 000 | 0,44 | |
| BANQUE FEDERATIVE D CREDIT MUTUEL-REG-S 0.60000% 17-05.04.27* | CHF | 1 030 000 | | | 1 030 000 | 999 100 | 0,47 | |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 0.40000% 17-19.12.25* | CHF | 1 285 000 | | 800 000 | 485 000 | 475 300 | 0,22 | |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 1.00000% 18-13.11.26* | CHF | 510 000 | | | 510 000 | 503 115 | 0,24 | |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.50000% 22-01.06.27* | CHF | 1 500 000 | | 600 000 | 900 000 | 897 750 | 0,42 | |
| BANQUE FEDERTVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.30000% 23-30.01.27* | CHF | 200 000 | | | 200 000 | 203 800 | 0,10 | |
| BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S 1.00000% 19-10.07.25* | CHF | 300 000 | | | 300 000 | 295 290 | 0,14 | |
| BARCLAYS PLC-REG-S 0.31500% 21-04.06.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 956 500 | 0,45 | |
| BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 14-08.09.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 497 750 | 0,23 | |
| BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WI-REG-S 2.95500% 22-29.11.27* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 413 800 | 0,19 | |
| BAWAG PSK BK FR ARBEIT WIRT O-REG-S 1.58500% 23-16.12.26* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 599 700 | 0,28 | |
| BERLIN HYP AG 2.25000% 23-08.11.27* | CHF | | 800 000 | | 800 000 | 816 400 | 0,38 | |
| BERLIN HYP AG-REG-S 0.25000% 20-11.09.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 374 800 | 0,18 | |
| BERLIN HYP AG-REG-S 0.96750% 22-04.08.26* | CHF | 450 000 | | | 450 000 | 445 725 | 0,21 | |
| BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BA-REG-S 0.35000% 21-15.03.27* | CHF | 615 000 | | | 615 000 | 528 814 | 0,25 | |
| BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24* | CHF | 1 150 000 | | 1 150 000 | | | | |
| BNG BANK NV 1.79250% 23-24.04.28* | CHF | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 330 716 | 0,63 | |
| BNG BANK NV-REG-S 2.50000% 05-21.07.25* | CHF | 1 785 000 | | 985 000 | 800 000 | 812 640 | 0,38 | |
| BNP PARIBAS SA 0.52750% 22-20.01.28* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 761 600 | 0,36 | |
| BNP PARIBAS SA 2.41250% 23-13.01.28* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 616 200 | 0,29 | |
| BNP PARIBAS SA-REG-S 0.30000% 19-15.10.27* | CHF | 600 000 | | 400 000 | 200 000 | 190 600 | 0,09 | |
| BNP PARIBAS SA-REG-S 0.15000% 20-10.03.28* | CHF | 600 000 | 400 000 | | 1 000 000 | 937 500 | 0,44 | |
| BNP PARIBAS SA-REG-S 0.14750% 21-13.07.27* | CHF | 800 000 | 1 000 000 | | 1 800 000 | 1 714 500 | 0,81 | |
| BNP PARIBAS-REG-S 0.50000% 21-16.03.29* | CHF | | 800 000 | | 800 000 | 747 600 | 0,35 | |
| BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 497 250 | 0,23 | |
| BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| BPCE SA-REG-S 2.28750% 24-15.03.29* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 007 500 | 0,47 | |
| CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATION-REG-S 0.25000% 18-30.05.25* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 592 500 | 0,28 | |
| CAIXABANK SA-REG-S 0.47700% 21-01.07.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 959 000 | 0,45 | |
| CAIXABANK SA-REG-S 2.17500% 24-19.03.30* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 604 200 | 0,28 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM/CAD-REG-S 0.12500% 15-22.12.25* | CHF | 1 050 000 | | | 1 050 000 | 1 026 900 | 0,48 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.05000% 19-15.10.26* | CHF | 350 000 | | | 350 000 | 336 875 | 0,16 | |
| CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.10000% 18-30.04.25* | CHF | 785 000 | | | 785 000 | 773 853 | 0,36 | |
| CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.28250% 22-03.02.27* | CHF | 1 500 000 | | 500 000 | 1 000 000 | 963 500 | 0,45 | |
| CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.73500% 20-27.11.24* | CHF | 1 250 000 | | | 1 250 000 | 1 240 000 | 0,58 | |
| CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| CELLNEX FINANCE CO SA 0.93500% 21-26.03.26* | CHF | 870 000 | | | 870 000 | 854 775 | 0,40 | |
| CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.11750% 20-17.07.25* | CHF | 665 000 | | | 665 000 | 658 417 | 0,31 | |
| CENTRAL AMERICAN BANK ECO INTEGR-REG-S 0.11000% 21-15.12.28* | CHF | | 825 000 | | 825 000 | 763 950 | 0,36 | |
| CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGR-REG-S 0.31400% 18-05.09.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGR-REG-S 0.40500% 20-25.06.25* | CHF | 1 820 000 | | | 1 820 000 | 1 792 518 | 0,84 | |
| CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA-REG-S 0.89000% 22-27.04.29* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 683 550 | 0,32 | |
| CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 17-22.11.24* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26* | CHF | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 281 150 | 0,60 | |
| CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 19-01.11.28* | CHF | 1 100 000 | 400 000 | | 1 500 000 | 1 423 500 | 0,67 | |
| CITIGROUP INC-REG-S 0.25000% 21-30.08.29* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 554 700 | 0,26 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 3.12500% 06-14.07.25* | CHF | 150 000 | | | 150 000 | 152 970 | 0,07 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 1.10000% 18-11.07.25* | CHF | 100 000 | | | 100 000 | 99 100 | 0,05 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 3.37500% 22-29.09.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 515 750 | 0,24 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 3.26250% 23-03.02.27* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 719 950 | 0,34 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 3.80000% 23-03.05.28* | CHF | | 300 000 | | 300 000 | 314 700 | 0,15 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.40000% 17-25.09.26* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 585 000 | 0,28 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.18750% 21-08.12.28* | CHF | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 1 129 800 | 0,53 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUS-REG-S 0.87500% 22-02.09.25* | CHF | 875 000 | | | 875 000 | 868 613 | 0,41 | |
| COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.90300% 23-16.06.28* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 022 000 | 0,48 | |
| COOPERATIVE RABOBANK UA-REG-S 2.48750% 23-25.01.29* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 026 500 | 0,48 | |
| CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.45000% 22-24.02.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 961 000 | 0,45 | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.50000% 14-01.12.28* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 687 750 | 0,32 | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.50000% 15-26.02.26* | CHF | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 959 000 | 0,92 | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25* | CHF | 1 175 000 | | | 1 175 000 | 1 159 843 | 0,55 | |
| CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.50000% 15-16.03.27* | CHF | 1 175 000 | | 600 000 | 575 000 | 560 625 | 0,26 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 15-18.06.26* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 682 850 | 0,32 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 17-27.07.27* | CHF | 1 400 000 | | 600 000 | 800 000 | 770 800 | 0,36 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 18-08.12.25* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 686 700 | 0,32 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.50000% 18-03.10.28* | CHF | 1 000 000 | 800 000 | | 1 800 000 | 1 729 800 | 0,81 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.45000% 19-24.01.29* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 381 800 | 0,18 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.82500% 23-26.05.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 407 400 | 0,19 | |
| CREDIT AGRICOLE SA 2.50750% 23-27.04.27* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 411 000 | 0,19 | |
| CREDIT AGRICOLE SA 2.36250% 23-05.10.28* | CHF | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 1 237 800 | 0,58 | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.12500% 14-30.10.24* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.55000% 16-14.12.26* | CHF | 715 000 | | | 715 000 | 694 980 | 0,33 | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 19-07.11.25* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 396 000 | 0,19 | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26* | CHF | 1 000 000 | | 400 000 | 600 000 | 581 700 | 0,27 | |
| CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.46040% 22-01.07.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 595 200 | 0,28 | |
| CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 3.04250% 22-29.09.27* | CHF | 800 000 | | 200 000 | 600 000 | 624 900 | 0,29 | |
| CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.19000% 22-07.12.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 510 250 | 0,24 | |
| CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 0.55000% 16-15.04.24* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.85000% 18-14.11.25* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 792 400 | 0,37 | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE BV-REG-S 1.50000% 14-26.08.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE BV-REG-S 0.10000% 15-01.12.25* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 392 400 | 0,18 | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 18-18.07.28* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 968 500 | 0,46 | |
| DEUTSCHE BANK AG 0.31500% 21-14.09.27* | CHF | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 141 800 | 0,54 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 397 040 | 0,19 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG-S 3.64500% 23-27.01.29* | CHF | 200 000 | 600 000 | | 800 000 | 828 000 | 0,39 | |
| DNB BANK ASA 2.68500% 23-15.06.28* | CHF | | 200 000 | | 200 000 | 204 500 | 0,10 | |
| DNB BANK ASA-REG-S 1.16750% 22-03.06.27* | CHF | 1 500 000 | | 600 000 | 900 000 | 887 400 | 0,42 | |
| DOHA FINANCE LTD-REG-S 0.46500% 22-24.01.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| DZ BANK AG DEUTSCHE ZEN GENBK-REG-S-SUB 3.61000% 23-16.10.28* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 618 000 | 0,29 | |
| E.ON SE 1.86000% 22-05.12.25* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 402 400 | 0,19 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 0.30000% 16-14.10.24* | CHF | 1 050 000 | | 1 050 000 | | | | |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA 2.30000% 23-14.09.27* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 612 900 | 0,29 | |
| ELI LILLY & CO-REG-S 0.45000% 16-24.05.28* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 775 600 | 0,36 | |
| ELO SACA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 23-15.06.26* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 608 100 | 0,29 | |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.55000% 17-03.09.24* | CHF | 865 000 | | 865 000 | | | | |
| ENGIE SA REG-S 2.34000% 23-04.01.27* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 408 400 | 0,19 | |
| ENGIE SA-REG-S 1.62500% 12-09.10.24* | CHF | 250 000 | | 250 000 | | | | |
| EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.17000% 17-18.07.25* | CHF | 570 000 | | | 570 000 | 560 424 | 0,26 | |
| EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.38250% 18-11.07.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25* | CHF | 1 020 000 | | 600 000 | 420 000 | 409 500 | 0,19 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.06800% 21-31.03.27* | CHF | 500 000 | 420 000 | | 920 000 | 871 240 | 0,41 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 767 200 | 0,36 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 394 600 | 0,19 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA 2.96000% 23-18.10.28* | CHF | | 565 000 | | 565 000 | 589 578 | 0,28 | |
| GLENCORE CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 1.00000% 20-30.03.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 588 000 | 0,28 | |
| GLENCORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.25000% 18-09.10.24* | CHF | 550 000 | | 550 000 | | | | |
| GLENCORE FINANCE EUROPE LTD-REG-S 0.35000% 19-10.09.25* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 981 500 | 0,46 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.50000% 17-04.12.24* | CHF | 750 000 | | 750 000 | | | | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25* | CHF | 1 300 000 | | 600 000 | 700 000 | 693 700 | 0,33 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.40000% 21-11.05.28* | CHF | 200 000 | 500 000 | | 700 000 | 666 400 | 0,31 | |
| HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.50000% 16-17.05.24* | CHF | 1 150 000 | | 1 150 000 | | | | |
| HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.32000% 21-03.11.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 954 000 | 0,45 | |
| HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.80500% 22-01.06.26* | CHF | 800 000 | | 400 000 | 400 000 | 399 000 | 0,19 | |
| HYPO NOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24* | CHF | 515 000 | | 515 000 | | | | |
| HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.45000% 18-05.03.24* | CHF | 495 000 | | 495 000 | | | | |
| HYPO VORARLBERG BANK-REG-S 0.25000% 18-12.11.25* | CHF | 1 015 000 | | | 1 015 000 | 995 715 | 0,47 | |
| HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.50000% 22-07.04.27* | CHF | 550 000 | | | 550 000 | 535 150 | 0,25 | |
| HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.69500% 18-27.06.23* | CHF | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.26000% 20-11.02.25* | CHF | 975 000 | | | 975 000 | 964 080 | 0,45 | |
| HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 1.87800% 22-14.06.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 603 000 | 0,28 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.02190% 19-16.07.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 832 660 | 0,39 | |
| INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL-REG-S 3.25000% 07-28.06.24* | CHF | 785 000 | | 785 000 | | | | |
| INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 794 080 | 0,37 | |
| JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.37500% 17-18.07.25* | CHF | 765 000 | | | 765 000 | 751 995 | 0,35 | |
| JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-14.07.28* | CHF | | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 283 100 | 0,60 | |
| JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.45000% 16-11.11.26* | CHF | 600 000 | | 200 000 | 400 000 | 390 000 | 0,18 | |
| KOMMUNALBANKEN A/S-REG-S 1.27500% 22-22.12.27* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 802 400 | 0,38 | |
| KOMMUNALKREDIT AUSTRIA AG-REG-S 3.37500% 06-22.06.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 516 000 | 0,24 | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25* | CHF | 1 025 000 | | | 1 025 000 | 1 012 905 | 0,48 | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 0.94000% 22-28.04.27* | CHF | 495 000 | | | 495 000 | 487 328 | 0,23 | |
| KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 0.25000% 17-07.06.24* | CHF | 1 305 000 | | 1 305 000 | | | | |
| KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 0.19250% 20-15.06.25* | CHF | 710 000 | | | 710 000 | 698 214 | 0,33 | |
| KOREA LAND & HOUSING CORP 1.82250% 24-13.02.26* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 401 600 | 0,19 | |
| KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.26250% 20-30.07.27* | CHF | 830 000 | | | 830 000 | 796 800 | 0,37 | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 2.50000% 05-25.08.25* | CHF | 2 950 000 | | 950 000 | 2 000 000 | 2 036 600 | 0,96 | |
| LA BANQUE POSTALE-REG-S 2.77250% 23-12.07.27* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 519 250 | 0,24 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.60250% 23-04.10.28* | CHF | | 300 000 | | 300 000 | 306 300 | 0,14 | |
| LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDBK-REG-S 1.35000% 22-30.09.27* | CHF | 300 000 | | | 300 000 | 302 550 | 0,14 | |
| LANSFORSÄKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.87500% 14-16.09.24* | CHF | 920 000 | | 920 000 | | | | |
| LANSFORSÄKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.20000% 18-17.04.26* | CHF | 730 000 | | | 730 000 | 715 035 | 0,34 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25* | CHF | 1 445 000 | | 400 000 | 1 045 000 | 1 040 193 | 0,49 | |
| LLOYDS BANKING GROUP 0.60250% 22-09.02.29* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 751 600 | 0,35 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 2.74500% 23-02.02.27* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 406 000 | 0,19 | |
| MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 0.39500% 21-20.07.28* | CHF | | 780 000 | | 780 000 | 741 780 | 0,35 | |
| MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.65000% 23-03.05.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 520 500 | 0,24 | |
| MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24* | CHF | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| MCDONALD'S CORP-REG-S 0.17000% 16-04.10.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL 1.96000% 23-12.10.26* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 708 750 | 0,33 | |
| METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 19-11.06.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 573 000 | 0,27 | |
| METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-25.09.28* | CHF | | 360 000 | | 360 000 | 336 960 | 0,16 | |
| METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.15000% 22-07.12.26* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 812 800 | 0,38 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.50000% 18-14.06.28* | CHF | | 1 800 000 | 800 000 | 1 000 000 | 964 500 | 0,45 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 18-31.10.24* | CHF | 1 145 000 | | 1 145 000 | | | | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 19-26.02.29* | CHF | | 300 000 | | 300 000 | 284 400 | 0,13 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 584 400 | 0,27 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 21-30.03.27* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 762 400 | 0,36 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK-REG-S 0.40000% 22-25.02.26* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 389 600 | 0,18 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.37500% 22-07.04.26* | CHF | 415 000 | | | 415 000 | 406 700 | 0,19 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 1.25000% 22-30.06.27* | CHF | 630 000 | | | 630 000 | 627 480 | 0,30 | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 1.75000% 23-23.06.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 507 750 | 0,24 | |
| MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 12-08.06.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 603 600 | 0,28 | |
| MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.75000% 14-17.09.24* | CHF | 370 000 | | 370 000 | | | | |
| MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 1.62500% 23-16.06.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 018 500 | 0,48 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.12500% 19-21.06.27* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 768 400 | 0,36 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.06500% 20-29.01.29* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 560 700 | 0,26 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.29250% 22-03.02.28* | CHF | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 1 151 400 | 0,54 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 2.20100% 23-12.04.29* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 414 200 | 0,19 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 1.95750% 22-03.11.27* | CHF | 750 000 | | | 750 000 | 765 000 | 0,36 | |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.91500% 22-08.09.28* | CHF | 200 000 | | | 200 000 | 201 700 | 0,09 | |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2.97000% 23-08.09.27* | CHF | | 200 000 | | 200 000 | 205 500 | 0,10 | |
| NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25* | CHF | 600 000 | | 400 000 | 200 000 | 198 820 | 0,09 | |
| NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.78250% 22-06.12.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 035 500 | 0,49 | |
| NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.85750% 23-06.06.28* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 625 800 | 0,29 | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.37500% 12-13.09.27* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 006 500 | 0,47 | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.25000% 12-09.08.24* | CHF | 415 000 | | 415 000 | | | | |
| NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 0.25000% 17-04.10.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 965 500 | 0,45 | |
| NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 19-18.10.27* | CHF | 1 715 000 | | | 1 715 000 | 1 642 113 | 0,77 | |
| NORDEA BANK ABP 2.49000% 23-26.05.28* | CHF | | 200 000 | | 200 000 | 206 300 | 0,10 | |
| NORDEA BANK ABP-REG-S 0.55000% 15-23.06.25* | CHF | 945 000 | | | 945 000 | 936 023 | 0,44 | |
| NORDEA BANK ABP-REG-S 0.12500% 20-02.06.26* | CHF | 1 000 000 | | 800 000 | 200 000 | 194 300 | 0,09 | |
| NORDEA BANK ABP-REG-S 1.81000% 22-15.06.27* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 005 500 | 0,47 | |
| NRW BANK-REG-S 1.62750% 23-27.07.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 021 500 | 0,48 | |
| ORANGE SA-REG-S 0.20000% 19-24.11.25* | CHF | 1 060 000 | | | 1 060 000 | 1 038 800 | 0,49 | |
| PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 21-26.10.28* | CHF | | 200 000 | | 200 000 | 188 100 | 0,09 | |
| PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.75000% 22-02.05.29* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 401 600 | 0,19 | |
| QUEBEC, PROVINCE OF-REG-S 0.75000% 14-21.11.24* | CHF | 750 000 | | 750 000 | | | | |
| RABOBANK NEDERLAND NV 1.36250% 22-28.04.28* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 394 600 | 0,19 | |
| RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 670 600 | 0,32 | |
| RCI BANQUE SA-REG-S 0.50000% 19-18.07.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| RCI BANQUE SA-REG-S 3.50000% 23-10.05.28* | CHF | | 1 250 000 | | 1 250 000 | 1 321 250 | 0,62 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.40000% 22-05.10.26* | CHF | 550 000 | | | 550 000 | 536 800 | 0,25 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.45000% 22-04.05.27* | CHF | 670 000 | | | 670 000 | 667 320 | 0,31 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.49500% 22-08.07.25* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 801 440 | 0,38 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.44500% 23-25.01.28* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 412 000 | 0,19 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.47500% 23-30.01.26* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 600 900 | 0,28 | |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 2.08500% 23-31.03.28* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 616 200 | 0,29 | |
| SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.15000% 19-10.12.24* | CHF | 850 000 | | 850 000 | | | | |
| SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.73250% 23-04.07.25* | CHF | | 300 000 | 200 000 | 100 000 | 101 420 | 0,05 | |
| SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.93250% 23-04.07.28* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 627 300 | 0,29 | |
| SANTANDER UK PLC-REG-S 2.01000% 23-12.09.26* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 710 500 | 0,33 | |
| SANTANDER UK PLC-REG-S 1.49420% 24-12.11.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 502 750 | 0,24 | |
| SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.38500% 21-22.07.26* | CHF | 465 000 | | | 465 000 | 448 493 | 0,21 | |
| SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27* | CHF | 405 000 | | | 405 000 | 385 358 | 0,18 | |
| SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.87500% 15-21.08.28* | CHF | | 2 600 000 | | 2 600 000 | 2 550 600 | 1,20 | |
| SOCIETE GENERALE 0.37500% 21-26.07.28* | CHF | 800 000 | 1 000 000 | | 1 800 000 | 1 688 400 | 0,79 | |
| SOCIETE GENERALE SA 2.27750% 23-27.02.26* | CHF | 1 000 000 | | 600 000 | 400 000 | 405 000 | 0,19 | |
| SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 20-25.02.27* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 382 200 | 0,18 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.74500% 22-26.01.29* | CHF | | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 314 600 | 0,62 | |
| SOCIETE GENERALE SA-REG-S 2.62500% 22-14.10.26* | CHF | 450 000 | | | 450 000 | 461 250 | 0,22 | |
| SOCIETE GENERALE-REG-S 0.70000% 18-26.02.25* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 396 680 | 0,19 | |
| SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT AS-REG-S 0.50750% 22-06.04.27* | CHF | 770 000 | | | 770 000 | 749 980 | 0,35 | |
| SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT AS 1.86750% 23-23.10.28* | CHF | | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 632 800 | 0,77 | |
| SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 2.70000% 23-20.03.29* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 029 000 | 0,48 | |
| SPAREBANK 1 SMN-REG-S 1.50000% 22-15.06.27* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 799 200 | 0,38 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.25000% 22-24.05.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 497 250 | 0,23 | |
| SWEDBANK AB 2.77250% 23-13.06.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 414 000 | 0,19 | |
| SWEDISH EXPORT CREDIT CORP-REG-S 1.02250% 22-21.09.27* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 594 900 | 0,28 | |
| TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.15000% 21-26.04.24* | CHF | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| THE TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 2.20250% 23-31.01.28* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 613 200 | 0,29 | |
| TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.97000% 23-18.09.26* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 709 800 | 0,33 | |
| TORONTO-DOMINION BANK/THE 1.48250% 24-30.01.29* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 702 450 | 0,33 | |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24* | CHF | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | | |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.50000% 15-01.06.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 488 750 | 0,23 | |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.28800% 18-13.07.26* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 980 000 | 0,46 | |
| TOYOTA MOTOR FINAN NETHERLANDS BV-REG-S 2.13000% 23-15.06.27* | CHF | | 545 000 | | 545 000 | 555 083 | 0,26 | |
| TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV 2.01000% 23-26.10.26* | CHF | | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 419 600 | 0,67 | |
| UBS AG LONDON BRANCH-REG-S 0.15000% 21-29.06.28* | CHF | | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 509 600 | 0,71 | |
| UBS AG, LONDON BRANCH-REG-S 2.33000% 22-14.11.25* | CHF | 850 000 | | | 850 000 | 861 475 | 0,41 | |
| UBS AG/LONDON-REG-S 2.38500% 23-09.05.25* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 504 900 | 0,24 | |
| VODAFONE GROUP PLC-REG-S 0.37500% 16-03.12.24* | CHF | 985 000 | | 985 000 | | | | |
| VODAFONE GROUP PLC-REG-S 0.62500% 17-15.03.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 489 000 | 0,23 | |
| VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 2.20750% 24-12.02.27* | CHF | | 650 000 | | 650 000 | 659 100 | 0,31 | |
| VONOVIA SE 2.56500% 24-14.02.29* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 510 000 | 0,24 | |
| WELLS FARGO & CO-REG-S 0.75000% 20-27.05.25* | CHF | 950 000 | | | 950 000 | 941 355 | 0,44 | |
| WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.30000% 17-28.11.25* | CHF | 450 000 | | | 450 000 | 441 900 | 0,21 | |
| WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.50000% 18-16.05.28* | CHF | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 1 155 000 | 0,54 | |
| WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.25000% 19-29.01.27* | CHF | 600 000 | 1 400 000 | 600 000 | 1 400 000 | 1 356 600 | 0,64 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 174 105 152 | 81,86 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 174 105 152 | 81,86 | |

Medium-Term Notes, Nullcoupon

CHF

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|---------|---------|------------------|-------------|--|
| CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATION-REG-S 0.00000% 20-16.06.26* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 389 000 | 0,18 | |
| EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.00000% 19-27.05.25* | CHF | 475 000 | | | 475 000 | 467 163 | 0,22 | |
| KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO-REG-S 0.00000% 19-19.07.24* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24* | CHF | 670 000 | | 670 000 | | | | |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.00000% 19-11.07.25* | CHF | 335 000 | | | 335 000 | 329 473 | 0,15 | |
| TOTAL CHF | | | | | | 1 185 635 | 0,56 | |
| Total Medium-Term Notes, Nullcoupon | | | | | | 1 185 635 | 0,56 | |

Anleihen, fester Zins

CHF

| | | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------|--|
| AKADEMISKA HUS AB-REG-S 0.35000% 22-24.03.27* | CHF | 445 000 | | | 445 000 | 432 540 | 0,20 | |
| ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.25000% 17-22.09.25* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 688 450 | 0,32 | |
| APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26* | CHF | 400 000 | | | 400 000 | 385 200 | 0,18 | |
| BANCO MER DEL NORTE SAVGRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24* | CHF | 845 000 | | 845 000 | | | | |
| BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23* | CHF | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 2.87000% 22-03.10.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 507 750 | 0,24 | |
| BANK OF MONTREAL 2.03750% 23-27.04.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 022 500 | 0,48 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA 0.29500% 22-25.04.25* | CHF | 535 000 | | | 535 000 | 528 687 | 0,25 | |
| BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23* | CHF | 130 000 | | 130 000 | | | | |
| BNG BANK NV 1.23750% 24-20.02.29* | CHF | | 515 000 | | 515 000 | 515 258 | 0,24 | |
| CAISSE DE REFINANC DE L'HABITAT-REG-S 1.75000% 13-26.06.25* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 003 000 | 0,47 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM-REG-S 1.91000% 23-14.07.28* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 611 100 | 0,29 | |
| CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE-REG-S 1.71250% 22-13.07.27* | CHF | 900 000 | 300 000 | 600 000 | 600 000 | 606 000 | 0,28 | |
| CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.30000% 17-07.04.25* | CHF | 950 000 | | | 950 000 | 937 555 | 0,44 | |
| DBS BANK LTD-REG-S 1.51500% 22-12.12.25* | CHF | 450 000 | | | 450 000 | 450 225 | 0,21 | |
| DIGITAL CONSTELLATION BV-REG-S 0.20000% 21-15.12.26* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 955 000 | 0,45 | |
| DIGITAL CONSTELLATION BV-REG-S 0.55000% 21-16.04.29* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 551 100 | 0,26 | |
| DIGITAL CONSTELLATION BV-REG-S 1.70000% 22-30.03.27* | CHF | 800 000 | | | 800 000 | 790 800 | 0,37 | |
| DZ BANK AG DEUTSCHE-REG-S 2.20250% 23-18.09.28* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 408 200 | 0,19 | |
| EMBOTELLADORA ANDINA SA-REG-S 2.71750% 23-20.09.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 517 000 | 0,24 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.37500% 07-15.10.27* | CHF | 1 300 000 | | 300 000 | 1 000 000 | 1 078 000 | 0,51 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.62500% 10-11.02.25* | CHF | 850 000 | | 850 000 | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.62500% 12-02.04.26* | CHF | 1 140 000 | | | 1 140 000 | 1 150 830 | 0,54 |
| EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.01750% 23-14.11.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 512 750 | 0,24 |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS DU 1.73500% 23-31.01.28* | CHF | 700 000 | | | 700 000 | 708 050 | 0,33 |
| FEDERATION DES CAISSES DESJ DU QUEB 1.35500% 24-18.04.27* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 699 587 | 0,33 |
| FONDO FINANCIERO-REG-S 0.55600% 21-03.09.26* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 478 750 | 0,23 |
| HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 1.80000% 22-27.05.27* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 503 000 | 0,24 |
| HYPONOE LANDESBANK FUER NIED-REG-S 2.37500% 24-26.01.29* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 405 600 | 0,19 |
| KAZAKHSTAN TEMIR ZHO NATI CO JSC-REG-S 3.25000% 18-05.12.23* | CHF | 610 000 | | 610 000 | | | |
| KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 2.15500% 22-14.10.25* | CHF | 300 000 | | | 300 000 | 302 850 | 0,14 |
| KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 2.46500% 22-14.10.27* | CHF | 200 000 | 1 000 000 | | 1 200 000 | 1 239 000 | 0,58 |
| KOREA HOUSING FINANCE CORP 1.89250% 23-10.02.28* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 608 400 | 0,29 |
| KOREA HOUSING FINANCE CORP 1.77800% 24-01.02.27* | CHF | | 600 000 | | 600 000 | 604 800 | 0,28 |
| KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.87500% 20-21.04.25* | CHF | 600 000 | | | 600 000 | 596 280 | 0,28 |
| LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 2.39000% 24-08.02.29* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 506 250 | 0,24 |
| LLOYDS BANK PLC-REG-S 1.87000% 23-31.08.27* | CHF | | 700 000 | | 700 000 | 711 900 | 0,33 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-REG-S 0.61700% 17-30.09.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 20-18.09.28* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 937 500 | 0,44 |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.75750% 23-23.01.26* | CHF | 1 200 000 | | 400 000 | 800 000 | 802 800 | 0,38 |
| NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF-REG-S 0.25000% 17-19.01.29* | CHF | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 952 500 | 0,45 |
| NORDIC INVESTMENT BANK 1.50000% 23-29.06.28* | CHF | | 500 000 | | 500 000 | 508 500 | 0,24 |
| NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.20000% 20-28.11.28* | CHF | | 2 200 000 | | 2 200 000 | 2 083 400 | 0,98 |
| OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG-REG-S 2.62500% 06-22.11.24* | CHF | 1 395 000 | | 1 395 000 | | | |
| RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 3.12500% 06-15.09.26* | CHF | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 040 500 | 0,49 |
| RZD CAPITAL PLC *DEFAULTED* 2.10000% 17-02.10.23* | CHF | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | |
| RZD CAPITAL PLC LPN-REG-S *DEFAULTED* 0.84000% 20-12.03.26* | CHF | 600 000 | | 600 000 | | | |
| TRANSPower NEW ZEALAND LTD 0.02000% 19-16.12.27* | CHF | | 400 000 | | 400 000 | 381 400 | 0,18 |
| WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.48000% 22-21.09.26* | CHF | 900 000 | | | 900 000 | 904 050 | 0,43 |
| TOTAL CHF | | | | | | 28 627 062 | 13,46 |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 28 627 062 | 13,46 |

Anleihen, Nullcoupon

CHF

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|--|-----------|---------|--------------------|---------------|
| KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.00000% 19-04.10.24* | CHF | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| KOREA RAILROAD CORP-REG-S 0.00000% 19-13.06.25* | CHF | 500 000 | | | 500 000 | 490 750 | 0,23 |
| TOTAL CHF | | | | | | 490 750 | 0,23 |
| Total Anleihen, Nullcoupon | | | | | | 490 750 | 0,23 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 210 279 975 | 98,87 |
| Total Wertschriften | | | | | | 210 279 975 | 98,87 |
| (davon ausgeliehen) | | | | | | | 0,00 |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 1 171 000 | 0,55 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 1 231 452 | 0,58 |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 212 682 427 | 100,00 |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | | | | | | -699 825 | |
| Nettofondsvermögen | | | | | | 211 982 602 | |

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 210 279 975 | 98,87 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | – | – |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | – | – |
| TOTAL | 210 279 975 | 98,87 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II

Klasse I-X

0,01%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

UBS (CH) Institutional Fund 3 – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

| | ISIN | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|-------------------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| Nettofondsvermögen in CHF | | 908 360 570.40 | 796 264 425.88 |
| Klasse I-X | CH1162399898 | | 1 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 942.47 | 956.75 |
| Anzahl Anteile im Umlauf | | 963 804,5130 | 832 263,6080 |

¹ Erstemission per 5.5.2022

Performance

| | Währung | 2023/2024 | 2022/2023 |
|--|---------|-----------|-----------|
| Klasse I-X | CHF | -0.9% | - |
| Benchmark: | | | |
| Bloomberg MSCI Global Aggregate ex-CHF Sustainability (hedged CHF) | CHF | -0.9% | - |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens

| | |
|--------------------|--------------|
| Vereinigte Staaten | 33,37 |
| Japan | 9,13 |
| Frankreich | 4,66 |
| Deutschland | 4,02 |
| Grossbritannien | 3,71 |
| Kanada | 2,82 |
| Italien | 2,75 |
| Supranational | 1,97 |
| Spanien | 1,90 |
| Australien | 1,38 |
| Übrige | 8,21 |
| TOTAL | 73,92 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

| | 31.3.2024 | 31.3.2023 |
|--|-------------------------|-----------------------------|
| Verkehrswerte | CHF | CHF |
| Bankguthaben | | |
| – auf Sicht | 328 506 238.31 | 799 467 927.69 ¹ |
| Effekten | | |
| – Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 893 692 130.26 | 786 020 042.68 |
| Derivative Finanzinstrumente | -19 519 926.36 | 13 387 324.20 |
| Sonstige Vermögenswerte | 6 278 605.91 | 4 442 457.54 |
| Gesamtfondsvermögen | 1 208 957 048.12 | 1 603 317 752.11 |
| Aufgenommene Kredite | -300 596 477.64 | -807 053 326.23 |
| Andere Verbindlichkeiten | -0.08 | 0.00 |
| Nettofondsvermögen | 908 360 570.40 | 796 264 425.88 |

Erfolgsrechnung

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 5.5.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|-----------------------|
| Ertrag | CHF | CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 167 064.91 | 4 855.24 |
| Negativzinsen | -12 143.36 | -11 268.86 |
| Erträge der Effekten | | |
| – aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten | 18 993 329.13 | 10 621 192.02 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 2 301 636.06 | 3 742 386.76 |
| TOTAL Ertrag | 21 449 886.74 | 14 357 165.16 |
| Aufwand | | |
| Passivzinsen | -4 022.71 | -5 942.15 |
| Prüfaufwand | -12 530.90 | 0.00 |
| Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-X | 0.00 | 0.00 |
| Sonstige Aufwendungen | -96 012.35 | -55 977.89 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | -570 484.26 | -365 585.37 |
| TOTAL Aufwand | -683 050.22 | -427 505.41 |
| Nettoertrag | 20 766 836.52 | 13 929 659.75 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 19 278 371.46 | 5 578 021.04 |
| Realisierter Erfolg | 40 045 207.98 | 19 507 680.79 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | -44 340 460.10 | -51 024 395.18 |
| Gesamterfolg | -4 295 252.12 | -31 516 714.39 |

¹ Zum 31. März 2023 wurden von UBS AG London Bankguthaben in Höhe von CHF 70 000.00 als Sicherheiten entgegengenommen.

Verwendung des Erfolges

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 5.5.2022-31.3.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres | 20 766 836.52 | 13 929 659.75 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 20 766 836.52 | 13 929 659.75 |
| Abzügl. Eidg. Verrechnungssteuer ¹ | -7 268 392.78 | -4 875 380.91 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg | -13 498 443.74 | -9 054 278.84 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 0.00 | 0.00 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 5.5.2022-31.3.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | CHF | CHF |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres | 796 264 425.88 | 0.00 |
| Abgeführte Verrechnungssteuer | -4 951 634.57 | 0.00 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | 121 343 031.21 | 827 781 140.27 |
| Gesamterfolg | -4 295 252.12 | -31 516 714.39 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode | 908 360 570.40 | 796 264 425.88 |

Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | 1.4.2023-31.3.2024 | 5.5.2022-31.3.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Klasse I-X | Anzahl | Anzahl |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr | 832 263,6080 | 0,0000 |
| Ausgegebene Anteile | 213 136,3120 | 867 827,8690 |
| Zurückgenommene Anteile | -81 595,4070 | -35 564,2610 |
| Bestand Ende Berichtsperiode | 963 804,5130 | 832 263,6080 |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 131 540,9050 | 832 263,6080 |

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

| Klasse I-X | | |
|---|------------|---------------|
| Thesaurierung per 16.7.2024 | | |
| Brutto Thesaurierungsbetrag | CHF | 21.546 |
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹ | CHF | -7.541 |
| Thesaurierung netto pro Anteil | CHF | 14.005 |

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizilierte Anleger gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs.1 VStV

Inventar des Fondsvermögens

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Mortgage Backed Securities, fester Zins | | | | | | | |
| USD | | | | | | | |
| FANNIE MAE 4.50000% 22-01.11.52* | USD | 375 000 | | 375 000 | 299 465 | 0,02 | |
| TOTAL USD | | | | | 299 465 | 0,02 | |
| Total Mortgage Backed Securities, fester Zins | | | | | 299 465 | 0,02 | |
| Notes, fester Zins | | | | | | | |
| AUD | | | | | | | |
| NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 3.00000% 16-20.02.30* | AUD | 800 000 | | 800 000 | 442 640 | 0,04 | |
| NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 2.00000% 20-08.03.33* | AUD | 500 000 | | 500 000 | 239 501 | 0,02 | |
| NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 23-20.02.36* | AUD | | 500 000 | 500 000 | 279 012 | 0,02 | |
| WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25* | AUD | 750 000 | | 750 000 | 445 679 | 0,04 | |
| TOTAL AUD | | | | | 1 406 832 | 0,12 | |
| CAD | | | | | | | |
| BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.20000% 19-18.06.30* | CAD | 900 000 | | 900 000 | 542 856 | 0,04 | |
| INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & 1.80000% 22-19.01.27* | CAD | 100 000 | | 100 000 | 62 526 | 0,01 | |
| MANITOBA, PROVINCE OF 2.75000% 19-02.06.29* | CAD | 250 000 | | 250 000 | 157 698 | 0,01 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 4.65000% 10-02.06.41* | CAD | 700 000 | | 700 000 | 483 566 | 0,04 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 2.90000% 18-02.06.28* | CAD | 200 000 | | 200 000 | 128 134 | 0,01 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 2.05000% 20-02.06.30* | CAD | 400 000 | 600 000 | 1 000 000 | 598 510 | 0,05 | |
| PROVINCE OF ONTARIO CANADA 3.75000% 22-02.06.32* | CAD | | 200 000 | 200 000 | 130 363 | 0,01 | |
| QUEBEC, PROVINCE OF 1.90000% 20-01.09.30* | CAD | 950 000 | | 950 000 | 560 578 | 0,05 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC 6.75000% 09-09.11.39* | CAD | | 200 000 | 200 000 | 150 406 | 0,01 | |
| TOTAL CAD | | | | | 2 814 637 | 0,23 | |
| EUR | | | | | | | |
| AMERICAN TOWER CORP 4.62500% 23-16.05.31* | EUR | | 200 000 | 200 000 | 204 140 | 0,02 | |
| ASAHI GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 0.01000% 21-19.04.24* | EUR | 200 000 | | 200 000 | | | |
| ASML HOLDING NV-REG-S 0.62500% 20-07.05.29* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 173 440 | 0,01 | |
| AT&T INC 1.60000% 20-19.05.28* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 273 228 | 0,02 | |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.90000% 23-20.02.33* | EUR | | 600 000 | 600 000 | 588 206 | 0,05 | |
| BAYER AG-REG-S 0.75000% 20-06.01.27* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 178 835 | 0,01 | |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 5.00000% 04-28.03.35* | EUR | 500 000 | | 500 000 | 581 270 | 0,05 | |
| BERLIN, STATE OF 1.62500% 22-02.08.32* | EUR | 350 000 | | 350 000 | 312 931 | 0,03 | |
| BERLIN, STATE OF-REG-S 0.01000% 20-26.10.28* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 128 974 | 0,01 | |
| BOOKING HOLDINGS INC 0.50000% 21-08.03.28* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 175 161 | 0,01 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP 0.62500% 19-01.12.27* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 176 657 | 0,01 | |
| BOUYGUES SA-REG-S 3.25000% 22-30.06.37* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 188 438 | 0,02 | |
| BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 2.82200% 20-07.04.32* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 279 036 | 0,02 | |
| BRANDENBURG, STATE OF-REG-S 0.05000% 21-01.07.31* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 80 578 | 0,01 | |
| BREMEN, STATE OF 0.45000% 22-15.03.29* | EUR | 250 000 | | 250 000 | 217 829 | 0,02 | |
| CAPGEMINI SE-REG-S 1.12500% 20-23.06.30* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 85 762 | 0,01 | |
| CHILE, REPUBLIC OF 0.55500% 21-21.01.29* | EUR | 400 000 | | 400 000 | 340 221 | 0,03 | |
| CHUBB INA HOLDINGS INC 0.87500% 19-15.12.29* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 85 207 | 0,01 | |
| CK HUTCHISON GROUP TELECOM FIN-REG-S 1.12500% 19-17.10.28* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 175 986 | 0,01 | |
| COCA-COLA CO/THE 1.00000% 21-09.03.41* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 137 310 | 0,01 | |
| CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 1.50000% 21-06.10.31* | EUR | | 200 000 | 200 000 | 161 765 | 0,01 | |
| CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.12500% 19-19.06.29* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 265 015 | 0,02 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG-S 1.75000% 19-09.12.49* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 109 413 | 0,01 | |
| DIAGEO FINANCE PLC-REG-S 1.87500% 20-27.03.27* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 93 591 | 0,01 | |
| DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 0.62500% 20-15.07.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 93 202 | 0,01 | |
| ESTONIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.25000% 24-17.01.34* | EUR | | 110 000 | 110 000 | 105 933 | 0,01 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.75000% 24-16.01.34* | EUR | | 600 000 | 600 000 | 581 879 | 0,05 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.75000% 24-17.07.29* | EUR | | 200 000 | 200 000 | 195 168 | 0,02 | |
| EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 3.00000% 23-23.08.33* | EUR | | 500 000 | 500 000 | 497 184 | 0,04 | |
| EUROPEAN UNION-REG-S 3.25000% 23-04.07.34* | EUR | | 700 000 | 700 000 | 703 457 | 0,06 | |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 2.95000% 19-21.05.39* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 134 062 | 0,01 | |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.12500% 21-15.04.52* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 46 449 | 0,00 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.50000% 22-15.09.32* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 353 086 | 0,03 | |
| GRAND-DUCHY OF LUXEMBOURG-REG-S 1.37500% 22-25.05.29* | EUR | 55 000 | | | 55 000 | 50 125 | 0,00 | |
| GRAND-DUCHY OF LUXEMBOURG-REG-S 1.75000% 22-25.05.42* | EUR | 50 000 | | | 50 000 | 40 507 | 0,00 | |
| GREECE, HELLENIC REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.25000% 23-15.06.33* | EUR | | 800 000 | | 800 000 | 836 949 | 0,07 | |
| HAMBURG, FREIE HANSESTADT 0.40000% 21-23.11.51* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 49 434 | 0,00 | |
| HESSEN, STATE OF-REG-S 0.01000% 20-11.03.30* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 332 716 | 0,03 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 20-05.06.35* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 74 872 | 0,01 | |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 20-18.11.30* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 154 911 | 0,01 | |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.30000% 20-11.02.28* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 349 406 | 0,03 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.50000% 10-01.03.26* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 597 194 | 0,05 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 4.45000% 23-01.09.43* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 407 470 | 0,03 | |
| JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 0.10000% 21-03.09.31* | EUR | | 250 000 | 250 000 | | | | |
| JOHN DEERE CASH MANAGEMENT-REG-S 1.85000% 20-02.04.28* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 186 722 | 0,02 | |
| KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 0.05000% 19-24.10.29* | EUR | 300 000 | 150 000 | | 450 000 | 376 826 | 0,03 | |
| LEGRAND SA-REG-S 3.50000% 23-29.05.29* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 98 848 | 0,01 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 87 472 | 0,01 | |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS 3.12500% 22-15.10.31* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 386 313 | 0,03 | |
| NIEDERSACHSEN, STATE OF-REG-S 0.01000% 20-13.08.30* | EUR | 600 000 | 500 000 | 400 000 | 700 000 | 574 443 | 0,05 | |
| PEPSICO INC 0.25000% 20-06.05.24* | EUR | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| PERNOD RICARD-REG-S 1.37500% 22-07.04.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 178 398 | 0,01 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.45000% 19-01.08.39* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 67 284 | 0,01 | |
| POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.62500% 24-11.01.34* | EUR | | 345 000 | | 345 000 | 335 561 | 0,03 | |
| PRAEMIA HEALTHCARE SACA-REG-S 0.87500% 19-04.11.29* | EUR | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| PROCTER & GAMBLE CO 0.35000% 21-05.05.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 83 530 | 0,01 | |
| RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.87500% 19-01.02.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 177 243 | 0,01 | |
| SACHSEN-ANHALT, FEDERAL STATE-REG-S 2.95000% 23-20.06.33* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 198 195 | 0,02 | |
| SANOHI-REG-S 1.25000% 22-06.04.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 178 572 | 0,01 | |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.80000% 20-30.07.27* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 454 890 | 0,04 | |
| STRYKER CORP 1.00000% 19-03.12.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 163 983 | 0,01 | |
| TAPESTRY INC 5.87500% 23-27.11.31* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 103 570 | 0,01 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE 1.62500% 21-18.10.41* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 146 022 | 0,01 | |
| UBS GROUP AG-REG-S 0.25000% 21-24.02.28* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 171 825 | 0,01 | |
| UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 1.75000% 20-25.03.30* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 181 139 | 0,01 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.12500% 21-19.09.35* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 225 472 | 0,02 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.50000% 24-28.06.32* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 292 594 | 0,02 | |
| VONOVIA SE-REG-S 1.00000% 21-16.06.33* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 73 418 | 0,01 | |
| VONOVIA SE-REG-S 1.50000% 21-14.06.41* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 187 560 | 0,02 | |
| WPC EUROOND BV 1.35000% 19-15.04.28* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 131 585 | 0,01 | |
| TOTAL EUR | | | | | | 15 678 460 | 1,30 | |
| GBP | | | | | | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.00000% 98-07.12.28* | GBP | 300 000 | | | 300 000 | 369 118 | 0,03 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.62500% 00-07.06.32* | GBP | 150 000 | | | 150 000 | 190 336 | 0,02 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 19-13.12.24* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 110 498 | 0,01 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.87500% 23-15.08.30* | GBP | | 200 000 | | 200 000 | 238 815 | 0,02 | |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 0.75000% 20-19.11.26* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 103 065 | 0,01 | |
| UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 3.75000% 23-22.10.53* | GBP | | 400 000 | | 400 000 | 406 105 | 0,03 | |
| UNITED KINGDOM-REG-S 1.12500% 22-22.10.73* | GBP | 450 000 | | | 450 000 | 195 133 | 0,02 | |
| WALMART INC-REG-S 5.62500% 09-27.03.34* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 124 091 | 0,01 | |
| TOTAL GBP | | | | | | 1 737 162 | 0,14 | |
| NOK | | | | | | | | |
| NORWAY, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.37500% 20-19.08.30* | NOK | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 145 924 | 0,01 | |
| TOTAL NOK | | | | | | 145 924 | 0,01 | |
| USD | | | | | | | | |
| ABBOTT LABORATORIES 4.75000% 17-15.04.43* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 260 123 | 0,02 | |
| ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 530 893 | 0,04 | |
| ABBVIE INC 4.25000% 20-21.11.49* | USD | 500 000 | | 150 000 | 350 000 | 273 019 | 0,02 | |
| ABBVIE INC 5.05000% 24-15.03.34* | USD | | 85 000 | | 85 000 | 77 508 | 0,01 | |
| ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.69600% 23-24.04.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 176 087 | 0,01 | |
| ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 342 153 | 0,03 | |
| ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 4.12500% 17-11.10.47* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 151 937 | 0,01 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC 3.40000% 17-15.06.27* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.30000% 21-30.01.32* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 270 372 | 0,02 | |
| AES CORP/THE 5.45000% 23-01.06.28* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 269 685 | 0,02 | |
| AIA GROUP LTD-REG-S 3.90000% 18-06.04.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 549 | 0,01 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | |
| AIR LEASE CORP 3.12500% 20-01.12.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 79 057 | 0,01 |
| AIR LEASE CORP 5.30000% 23-01.02.28* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 270 356 | 0,02 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 2.05000% 20-15.05.30* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 231 288 | 0,02 |
| ALABAMA POWER CO 3.12500% 21-15.07.51* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 248 727 | 0,02 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.70000% 18-01.07.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 87 327 | 0,01 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.95000% 22-15.03.34* | USD | 350 000 | | 350 000 | | 258 979 | 0,02 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.50000% 15-28.11.34* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 170 166 | 0,01 |
| ALLSTATE CORP/THE 1.45000% 20-15.12.30* | USD | 250 000 | | 250 000 | | 178 313 | 0,01 |
| ALLY FINANCIAL INC 2.20000% 21-02.11.28* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 77 208 | 0,01 |
| ALPHABET INC 1.90000% 20-15.08.40* | USD | 350 000 | 100 000 | 250 000 | | 151 257 | 0,01 |
| ALTRIA GROUP INC 2.62500% 16-16.09.26* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 84 893 | 0,01 |
| ALTRIA GROUP INC 5.95000% 19-14.02.49* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 91 667 | 0,01 |
| AMAZON.COM INC 2.70000% 20-03.06.60* | USD | 250 000 | | 250 000 | | 139 557 | 0,01 |
| AMAZON.COM INC 3.60000% 22-13.04.32* | USD | 500 000 | | 500 000 | | 419 418 | 0,03 |
| AMAZON.COM INC 3.87500% 18-22.08.37* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 162 619 | 0,01 |
| AMAZON.COM INC 4.55000% 22-01.12.27* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 270 066 | 0,02 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER INC 3.20000% 17-13.11.27* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 84 561 | 0,01 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC 3.25000% 20-01.03.50* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 62 173 | 0,01 |
| AMERICAN EXPRESS CO-SUB 3.62500% 14-05.12.24* | USD | 500 000 | 250 000 | 250 000 | | 222 303 | 0,02 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.90000% 16-01.04.26* | USD | 150 000 | 150 000 | | | | |
| AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 16-15.10.26* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 86 030 | 0,01 |
| AMERICAN TOWER CORP 2.70000% 21-15.04.31* | USD | 250 000 | | 250 000 | | 190 624 | 0,02 |
| AMERICAN TOWER CORP 2.30000% 21-15.09.31* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 73 513 | 0,01 |
| AMGEN INC 2.20000% 20-21.02.27* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 83 404 | 0,01 |
| AMGEN INC 2.80000% 21-15.08.41* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 195 769 | 0,02 |
| AMGEN INC 4.66300% 17-15.06.51* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 239 326 | 0,02 |
| AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33* | USD | 250 000 | 250 000 | 500 000 | | 454 138 | 0,04 |
| ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 4.50000% 18-15.03.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 174 398 | 0,01 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 5.45000% 19-23.01.39* | USD | 450 000 | | 450 000 | | 418 484 | 0,03 |
| ANHEUSER-BUSCH WORLDWIDE INC 5.55000% 19-23.01.49* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 375 642 | 0,03 |
| ANTHEM INC 3.65000% 17-01.12.27* | USD | 400 000 | 400 000 | | | | |
| ANTHEM INC 4.55000% 18-01.03.48* | USD | | 200 000 | 200 000 | | 158 350 | 0,01 |
| ANTHEM INC 4.55000% 22-15.05.52* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 78 824 | 0,01 |
| AON CORP / AON GLOBAL HOLDINGS PLC 3.90000% 22-28.02.52* | USD | | 200 000 | 200 000 | | 138 411 | 0,01 |
| APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28* | USD | 600 000 | | 600 000 | | 477 805 | 0,04 |
| APPLE INC 2.80000% 21-08.02.61* | USD | 350 000 | | 350 000 | | 201 655 | 0,02 |
| APPLE INC 3.35000% 17-09.02.27* | USD | 250 000 | | 250 000 | | 217 562 | 0,02 |
| APPLE INC 3.75000% 17-13.11.47* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 222 941 | 0,02 |
| APPLIED MATERIALS INC 1.75000% 20-01.06.30* | USD | | 300 000 | 300 000 | | 227 653 | 0,02 |
| APTIV PLC 3.10000% 21-01.12.51* | USD | 150 000 | | 150 000 | | 85 210 | 0,01 |
| ARCHER-DANIELS MIDLAND CO 3.75000% 17-15.09.47* | USD | 75 000 | | 75 000 | | 52 262 | 0,00 |
| ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.90000% 24-26.02.31* | USD | | 350 000 | 350 000 | | 316 287 | 0,03 |
| ASTRAZENECA PLC 0.70000% 20-08.04.26* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 248 523 | 0,02 |
| ASTRAZENECA PLC 3.00000% 21-28.05.51* | USD | 75 000 | | 75 000 | | 47 408 | 0,00 |
| AT&T INC 2.55000% 21-01.12.33* | USD | 800 000 | | 800 000 | | 577 151 | 0,05 |
| AT&T INC 2.75000% 20-01.06.31* | USD | | 500 000 | 500 000 | | 387 914 | 0,03 |
| AT&T INC 3.65000% 21-15.09.59* | USD | 700 000 | | 700 000 | | 438 955 | 0,04 |
| ATMOS ENERGY CORP 5.90000% 23-15.11.33* | USD | | 300 000 | 300 000 | | 286 639 | 0,02 |
| AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 2.57000% 20-25.11.35* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 147 584 | 0,01 |
| BAE SYSTEMS PLC-144A 3.00000% 20-15.09.50* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 121 665 | 0,01 |
| BAIDU INC 1.72000% 20-09.04.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 167 847 | 0,01 |
| BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 4.08000% 18-15.12.47* | USD | 150 000 | | 150 000 | | 111 524 | 0,01 |
| BAT CAPITAL CORP 5.28200% 20-02.04.50* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 232 018 | 0,02 |
| BAT CAPITAL CORP 6.42100% 23-02.08.33* | USD | | 300 000 | 300 000 | | 282 659 | 0,02 |
| BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.37500% 18-15.12.28* | USD | 400 000 | | 400 000 | | 339 108 | 0,03 |
| BECTON DICKINSON AND CO 2.82300% 20-20.05.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 79 477 | 0,01 |
| BECTON DICKINSON AND CO 4.29800% 22-22.08.32* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 256 399 | 0,02 |
| BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 5.15000% 13-15.11.43* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 175 804 | 0,01 |
| BLACKROCK INC 3.25000% 19-30.04.29* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 252 918 | 0,02 |
| BOEING CO 5.70500% 20-01.05.40* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 172 419 | 0,01 |
| BOEING CO 5.93000% 20-01.05.60* | USD | 250 000 | | 250 000 | | 211 109 | 0,02 |
| BOEING CO/THE 2.19600% 21-04.02.26* | USD | 650 000 | | 650 000 | | 548 103 | 0,05 |
| BOSTON GAS CO-144A 3.15000% 17-01.08.27* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 83 532 | 0,01 |
| BOSTON PROPERTIES LP 3.20000% 17-15.01.25* | USD | 200 000 | | 200 000 | | 176 501 | 0,01 |
| BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 4.23400% 18-06.11.28* | USD | 300 000 | | 300 000 | | 264 438 | 0,02 |
| BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.00000% 20-24.02.50* | USD | | 150 000 | 150 000 | | 92 171 | 0,01 |
| BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.63300% 20-06.04.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 84 839 | 0,01 |
| BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.06000% 21-17.06.41* | USD | 100 000 | | 100 000 | | 68 376 | 0,01 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB CO 3.40000% 20-26.07.29* | USD | 500 000 | | 500 000 | | 423 030 | 0,03 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB CO 4.12500% 20-15.06.39* | USD | 100 000 | 200 000 | 300 000 | | 239 444 | 0,02 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 6.40000% 23-15.11.63* | USD | | 200 000 | 200 000 | | 205 884 | 0,02 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | in % ³ | | | |
| BROOKFIELD FINANCE INC 3.90000% 18-25.01.28* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 86 727 | 0,01 | |
| CANADA, GOVERNMENT 0.75000% 21-19.05.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 165 975 | 0,01 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.94500% 22-04.08.25* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 353 834 | 0,03 | |
| CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 2.75000% 16-01.03.26* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 86 541 | 0,01 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 6.25000% 07-15.03.38* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 93 734 | 0,01 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 2.90000% 15-01.02.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 264 058 | 0,02 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.45000% 21-02.12.31* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 80 827 | 0,01 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.75000% 17-09.03.27* | USD | 500 000 | 200 000 | | 700 000 | 605 132 | 0,05 | |
| CARRIER GLOBAL CORP 2.72200% 20-15.02.30* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| CARRIER GLOBAL CORP 3.37700% 20-05.04.40* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 70 516 | 0,01 | |
| CCO LLC/CAPITAL 5.75000% 18-01.04.48* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 227 545 | 0,02 | |
| CELANESE US HOLDINGS LLC 6.16500% 22-15.07.27* | USD | 150 000 | 150 000 | | 300 000 | 275 212 | 0,02 | |
| CENOVUS ENERGY INC 2.65000% 21-15.01.32* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 74 709 | 0,01 | |
| CENTENE CORP 2.62500% 21-01.08.31* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 369 682 | 0,03 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC 1.45000% 21-01.06.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 332 721 | 0,03 | |
| CHARLES SCHWAB CORP 3.20000% 17-02.03.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 342 945 | 0,03 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / 3.90000% 21-01.06.52* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 229 126 | 0,02 | |
| CHEVRON CORP 2.89500% 17-03.03.24* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| CHEVRON USA INC 3.85000% 21-15.01.28* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 264 065 | 0,02 | |
| CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 20-27.01.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 152 275 | 0,01 | |
| CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50* | USD | 200 000 | 400 000 | | 600 000 | 393 777 | 0,03 | |
| CHUBB INA HOLDINGS INC 1.37500% 20-15.09.30* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 73 296 | 0,01 | |
| CHUBB INA HOLDINGS INC 3.05000% 21-15.12.61* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 120 619 | 0,01 | |
| CIGNA CORP 4.12500% 19-15.11.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| CIGNA CORP 4.90000% 19-15.12.48* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 123 071 | 0,01 | |
| CIGNA GROUP/THE 5.40000% 23-15.03.33* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 229 269 | 0,02 | |
| CISCO SYSTEMS INC 2.95000% 16-28.02.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 855 | 0,01 | |
| CISCO SYSTEMS INC 5.05000% 24-26.02.34* | USD | | 155 000 | | 155 000 | 141 488 | 0,01 | |
| CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 438 438 | 0,04 | |
| CITIGROUP INC 4.65000% 18-23.07.48* | USD | 100 000 | 200 000 | | 300 000 | 244 495 | 0,02 | |
| CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 525 718 | 0,04 | |
| CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 1.45000% 21-15.07.26* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 82 678 | 0,01 | |
| COCA-COLA CO 3.45000% 20-25.03.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 254 029 | 0,02 | |
| COCA-COLA CO/THE 2.60000% 20-01.06.50* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 58 895 | 0,00 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO 3.25000% 22-15.08.32* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 203 667 | 0,02 | |
| COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 439 544 | 0,04 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.87500% 21-15.09.31* | USD | 215 000 | | | 215 000 | 157 234 | 0,01 | |
| CONAGRA BRANDS INC 1.37500% 20-01.11.27* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 78 811 | 0,01 | |
| CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 2.40000% 21-15.06.31* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 383 193 | 0,03 | |
| CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 5.90000% 23-15.11.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 192 256 | 0,02 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC 3.70000% 16-06.12.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 260 669 | 0,02 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.00000% 19-30.09.29* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 398 560 | 0,03 | |
| CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.70000% 19-30.01.50* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 123 903 | 0,01 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP 3.00000% 17-18.05.27* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 86 165 | 0,01 | |
| CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 7.95000% 23-09.01.25* | USD | 295 000 | | | 295 000 | 270 112 | 0,02 | |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.70000% 16-15.06.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 968 | 0,01 | |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 2.10000% 21-01.04.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 145 815 | 0,01 | |
| CSX CORP 3.80000% 20-15.04.50* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 211 010 | 0,02 | |
| CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 159 670 | 0,01 | |
| CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48* | USD | 450 000 | | | 450 000 | 368 098 | 0,03 | |
| CVS HEALTH CORP 5.30000% 23-01.06.33* | USD | | 380 000 | | 380 000 | 343 071 | 0,03 | |
| DANAHER CORP 3.35000% 15-15.09.25* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 88 093 | 0,01 | |
| DANONE-144A 2.94700% 16-02.11.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 256 489 | 0,02 | |
| DEERE & CO 3.90000% 12-09.06.42* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 77 816 | 0,01 | |
| DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.25000% 23-01.02.28* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 273 487 | 0,02 | |
| DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 8.35000% 21-15.07.46* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 116 504 | 0,01 | |
| DEVON ENERGY CORP 5.00000% 15-15.06.45* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 159 835 | 0,01 | |
| DIAGEO CAPITAL PLC 2.00000% 20-29.04.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 229 933 | 0,02 | |
| DIGITAL REALTY TRUST LP 3.60000% 19-01.07.29* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 248 974 | 0,02 | |
| DOLLAR GENERAL CORP 5.45000% 23-05.07.33* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 225 881 | 0,02 | |
| DOMINION ENERGY INC 4.70000% 14-01.12.44* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 78 284 | 0,01 | |
| DOMINION ENERGY INC 4.85000% 22-15.08.52* | USD | 200 000 | | 100 000 | 100 000 | 80 524 | 0,01 | |
| DOW CHEMICAL CO 4.80000% 19-30.11.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 699 | 0,01 | |
| DOW CHEMICAL CO/THE 4.37500% 12-15.11.42* | USD | 100 000 | 150 000 | | 250 000 | 192 413 | 0,02 | |
| DUKE ENERGY CORP 5.00000% 22-15.08.52* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 326 114 | 0,03 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC 4.72500% 18-15.11.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 887 | 0,01 | |
| EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33* | USD | 145 000 | | | 145 000 | 123 888 | 0,01 | |
| EBAY INC 2.70000% 20-11.03.30* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 79 735 | 0,01 | |
| ECOLAB INC 2.70000% 21-15.12.51* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 58 239 | 0,00 | |
| EDISON INTERNATIONAL 5.75000% 19-15.06.27* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| ELI LILLY & CO 2.75000% 15-01.06.25* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 87 704 | 0,01 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | |
| ELI LILLY & CO 4.70000% 23-27.02.33* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 269 513 | 0,02 |
| EMERSON ELECTRIC CO 2.75000% 20-15.10.50* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 145 667 | 0,01 |
| EMERSON ELECTRIC CO 3.15000% 15-01.06.25* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 88 001 | 0,01 |
| ENBRIDGE INC 2.50000% 21-01.08.33* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 217 725 | 0,02 |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.50000% 17-06.04.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 781 | 0,01 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.85000% 13-15.03.44* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 294 610 | 0,02 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 2.80000% 20-31.01.30* | USD | 100 000 | 300 000 | | 400 000 | 322 920 | 0,03 |
| EQT CORP 5.75000% 24-01.02.34* | USD | | 65 000 | | 65 000 | 58 352 | 0,00 |
| EQUINIX INC 2.62500% 19-18.11.24* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 88 256 | 0,01 |
| EQUINIX INC 2.90000% 19-18.11.26* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 253 471 | 0,02 |
| EQUINOR ASA 2.87500% 20-06.04.25* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 439 856 | 0,04 |
| EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 362 | 0,01 |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE 5.15000% 23-15.05.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 175 184 | 0,01 |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 21-14.02.31* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 221 955 | 0,02 |
| EVERGY INC 2.45000% 19-15.09.24* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 221 666 | 0,02 |
| EVERSOURCE ENERGY 3.37500% 22-01.03.32* | USD | 300 000 | 200 000 | | 500 000 | 391 853 | 0,03 |
| EXELON CORP 4.05000% 20-15.04.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 339 773 | 0,03 |
| EXPORT DEVELOPMENT CANADA 3.87500% 23-14.02.28* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 352 952 | 0,03 |
| EXXON MOBIL CORP 2.70900% 15-06.03.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 136 | 0,01 |
| EXXON MOBIL CORP 3.45200% 20-15.04.51* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 204 707 | 0,02 |
| FEDEX CORP 3.40000% 18-15.02.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 170 806 | 0,01 |
| FEDEX CORP 5.25000% 20-15.05.50* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 86 272 | 0,01 |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 2.25000% 21-01.03.31* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | |
| FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 335 481 | 0,03 |
| FOX CORP 4.03000% 20-25.01.24* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | |
| FOX CORP 6.50000% 23-13.10.33* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 286 202 | 0,02 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC 5.40000% 14-14.11.34* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 222 443 | 0,02 |
| GATX CORP 4.90000% 22-15.03.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 366 | 0,01 |
| GENERAL DYNAMICS CORP 3.62500% 20-01.04.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 338 661 | 0,03 |
| GENERAL MILLS INC 2.25000% 21-14.10.31* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 223 416 | 0,02 |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.50000% 21-10.06.26* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 414 257 | 0,03 |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 21-10.06.31* | USD | 500 000 | 300 000 | | 500 000 | 375 395 | 0,03 |
| GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 85 639 | 0,01 |
| GILEAD SCIENCES INC 2.80000% 20-01.10.50* | USD | 275 000 | | | 275 000 | 161 456 | 0,01 |
| GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 3.37500% 19-01.06.29* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 254 654 | 0,02 |
| GLOBAL PAYMENTS INC 5.40000% 22-15.08.32* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 267 982 | 0,02 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.25000% 11-01.02.41* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 294 223 | 0,02 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.62500% 19-20.02.24* | USD | 700 000 | | 700 000 | | | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.60000% 20-07.02.30* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 315 359 | 0,03 |
| GSK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL US LLC 3.62500% 22-24.03.32* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 202 930 | 0,02 |
| HALLIBURTON CO 5.00000% 15-15.11.45* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 84 563 | 0,01 |
| HCA INC 5.50000% 17-15.06.47* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 256 869 | 0,02 |
| HEALTHPEAK OP LLC 2.12500% 21-01.12.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 158 421 | 0,01 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 268 406 | 0,02 |
| HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 120 343 | 0,01 |
| HOME DEPOT INC 3.62500% 22-15.04.52* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 68 792 | 0,01 |
| HOME DEPOT INC/THE 4.95000% 23-30.09.26* | USD | | 240 000 | | 240 000 | 216 518 | 0,02 |
| HOME DEPOT INC/THE 5.87500% 06-16.12.36* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 290 190 | 0,02 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC 1.95000% 20-01.06.30* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 191 827 | 0,02 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC 1.75000% 21-01.09.31* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 109 654 | 0,01 |
| HONG KONG AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.50000% 22-12.01.32* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 310 119 | 0,03 |
| HOST HOTELS & RESORTS LP 3.37500% 19-15.12.29* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 200 544 | 0,02 |
| HP INC 1.45000% 22-17.06.26* | USD | 150 000 | | 150 000 | | | |
| HP INC 4.75000% 22-15.01.28* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 358 185 | 0,03 |
| HSBC HOLDINGS PLC-SUB 6.50000% 07-15.09.37* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 95 917 | 0,01 |
| HUMANA INC 3.70000% 22-23.03.29* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 254 275 | 0,02 |
| HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 21-21.09.51* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 114 051 | 0,01 |
| IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 4.25000% 15-21.07.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 265 262 | 0,02 |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 4.85000% 23-11.01.33* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 446 500 | 0,04 |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 5.65000% 23-11.01.53* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 374 969 | 0,03 |
| INTEL CORP 3.73400% 18-08.12.47* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 69 976 | 0,01 |
| INTEL CORP 3.75000% 20-25.03.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 349 744 | 0,03 |
| INTEL CORP 4.90000% 22-05.08.52* | USD | 200 000 | 150 000 | | 350 000 | 294 282 | 0,02 |
| INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 808 | 0,01 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 3.750000% 15-01.12.25* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 352 629 | 0,03 |
| INTERCONTINENTAL EXCH INC 5.20000% 22-15.06.62* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 132 177 | 0,01 |
| INTERN BK FOR RECONSTR & DEVELP 3.50000% 23-12.07.28* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 217 601 | 0,02 |
| INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 4.75000% 23-14.11.33* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 371 337 | 0,03 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.70000% 16-19.02.46* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 83 007 | 0,01 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26* | USD | 550 000 | | | 550 000 | 477 983 | 0,04 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 5.10000% 23-06.02.53* | USD | | 200 000 | 100 000 | 100 000 | 87 220 | 0,01 |
| INTERNATIONAL PAPER CO 4.35000% 17-15.08.48* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 152 145 | 0,01 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 4.65000% 18-01.10.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 955 | 0,01 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen | |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.00000% 18-27.09.23* | USD | 800 000 | | 800 000 | | | | |
| INTUIT INC 5.25000% 23-15.09.26* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 136 370 | 0,01 | |
| ITALY, REPUBLIC OF 1.25000% 20-17.02.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 082 | 0,01 | |
| J M SMUCKER CO/THE 6.50000% 23-15.11.53* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 250 053 | 0,02 | |
| JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 2.75000% 16-21.01.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 346 416 | 0,03 | |
| JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 1.87500% 21-15.04.31* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 302 081 | 0,02 | |
| JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 298 023 | 0,02 | |
| JOHNSON & JOHNSON 3.70000% 16-01.03.46* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 112 822 | 0,01 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 1.75000% 20-15.09.30* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 111 142 | 0,01 | |
| JPMORGAN CHASE & CO 3.90000% 15-15.07.25* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 620 089 | 0,05 | |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC-REG-5 3.50000% 20-14.04.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 149 631 | 0,01 | |
| KELLANOVA 3.25000% 16-01.04.26* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 130 298 | 0,01 | |
| KEURIG DR PEPPER INC 3.40000% 15-15.11.25* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 87 415 | 0,01 | |
| KEURIG DR PEPPER INC 3.80000% 20-01.05.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 137 923 | 0,01 | |
| KEYBANK NA/CLEVELAND OH 4.15000% 22-08.08.25* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 218 878 | 0,02 | |
| KILROY REALTY LP 6.25000% 24-15.01.36* | USD | | 50 000 | | 50 000 | 43 991 | 0,00 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP 2.75000% 16-15.02.26* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 86 719 | 0,01 | |
| KIMCO REALTY OP, LLC 4.60000% 22-01.02.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 170 527 | 0,01 | |
| KINDER MORGAN INC 2.00000% 20-15.02.31* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 222 235 | 0,02 | |
| KINDER MORGAN INC 5.20000% 18-01.03.48* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 81 054 | 0,01 | |
| KLA CORP 4.65000% 22-15.07.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 177 268 | 0,01 | |
| KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 1.37500% 21-25.04.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 325 445 | 0,03 | |
| KOREA GAS CORP-REG-S 4.87500% 23-05.07.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 179 886 | 0,01 | |
| KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 228 204 | 0,02 | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.12500% 23-15.07.33* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 442 348 | 0,04 | |
| KROGER CO 3.50000% 16-01.02.26* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 87 468 | 0,01 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC 5.40000% 23-31.07.33* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 362 544 | 0,03 | |
| LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 21-30.03.26* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 125 298 | 0,01 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP 3.40000% 20-15.01.31* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 237 744 | 0,02 | |
| LOWE'S COS IN 4.25000% 22-01.04.52* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 73 794 | 0,01 | |
| LOWE'S COS INC 3.10000% 17-03.05.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 341 663 | 0,03 | |
| LOWE'S COS INC 5.62500% 22-15.04.53* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 181 943 | 0,02 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP 4.15000% 16-04.03.26* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 88 560 | 0,01 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC 2.75000% 21-15.10.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 146 403 | 0,01 | |
| MARSH & MCLENNAN COS INC 4.75000% 19-15.03.39* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 85 458 | 0,01 | |
| MARSH & MCLENNAN COS INC 5.45000% 23-15.03.53* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 135 984 | 0,01 | |
| MASTERCARD INC 2.95000% 16-21.11.26* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 85 995 | 0,01 | |
| MASTERCARD INC 3.85000% 20-26.03.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 149 057 | 0,01 | |
| MERCK & CO INC 2.15000% 21-10.12.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 150 770 | 0,01 | |
| MERCK & CO INC 2.75000% 15-10.02.25* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 352 804 | 0,03 | |
| MERCK & CO INC 2.75000% 21-10.12.51* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 117 768 | 0,01 | |
| METLIFE INC 3.60000% 15-13.11.25* | USD | 550 000 | | | 550 000 | 483 316 | 0,04 | |
| METLIFE INC 5.25000% 23-15.01.54* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 133 000 | 0,01 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC 3.36600% 21-01.11.41* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 133 833 | 0,01 | |
| MICROSOFT CORP 2.92100% 21-17.03.52* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 254 709 | 0,02 | |
| MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 436 518 | 0,04 | |
| MIYUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.85000% 16-01.03.26* | USD | 260 000 | | | 260 000 | 228 681 | 0,02 | |
| MIYUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 4.15300% 19-07.03.39* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 122 534 | 0,01 | |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.17000% 17-11.09.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 338 081 | 0,03 | |
| MOLSON COORS BREWING CO 4.20000% 16-15.07.46* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 75 260 | 0,01 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.75000% 20-13.04.30* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 80 113 | 0,01 | |
| MOODY'S CORP 2.00000% 21-19.08.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 146 734 | 0,01 | |
| MORGAN STANLEY 4.37500% 17-22.01.47* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 78 973 | 0,01 | |
| MORGAN STANLEY-SUB 5.00000% 13-24.11.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 026 | 0,01 | |
| MPLX LP 4.50000% 18-15.04.38* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 159 971 | 0,01 | |
| MPLX LP 5.50000% 18-15.02.49* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 171 486 | 0,01 | |
| NASDAQ INC 3.85000% 16-30.06.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 175 265 | 0,01 | |
| NASDAQ INC 5.55000% 23-15.02.34* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 183 179 | 0,02 | |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 1.50000% 21-13.10.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 328 755 | 0,03 | |
| NATWEST GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| NEWMONT CORP 2.60000% 21-15.07.32* | USD | 200 000 | 150 000 | | 350 000 | 263 841 | 0,02 | |
| NEXTERA ENERGY CAP 2.44000% 21-15.01.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 148 870 | 0,01 | |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 4.62500% 22-15.07.27* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 444 071 | 0,04 | |
| NIKE INC 2.85000% 20-27.03.30* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| NISOURCE INC 0.95000% 20-15.08.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 169 522 | 0,01 | |
| NISOURCE INC 5.25000% 23-30.03.28* | USD | | 120 000 | | 120 000 | 108 827 | 0,01 | |
| NISSAN MOTOR CO LTD-144A 4.81000% 20-17.09.30* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 252 316 | 0,02 | |
| NOMURA HOLDINGS INC 2.67900% 20-16.07.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 308 685 | 0,03 | |
| NORDIC INVESTMENT BANK 4.37500% 23-14.03.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 567 | 0,01 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP 3.85000% 13-15.01.24* | USD | 150 000 | | 150 000 | | | | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP 4.55000% 22-01.06.53* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 157 224 | 0,01 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Davon ausgeliehen | | |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Anzahl/ Nominal |
| NORTHROP GRUMMAN CORP 4.70000% 23-15.03.33* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 351 715 | 0,03 | |
| NUCOR CORP 3.95000% 18-01.05.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 118 | 0,01 | |
| NUTRIEN LTD 3.95000% 20-13.05.50* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 105 382 | 0,01 | |
| NVIDIA CORP 1.55000% 21-15.06.28* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 120 450 | 0,01 | |
| OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 0.37500% 20-17.09.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 252 967 | 0,02 | |
| ONEOK INC 4.55000% 18-15.07.28* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 132 518 | 0,01 | |
| ONEOK INC 6.35000% 20-15.01.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 190 729 | 0,02 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 1.05000% 20-21.05.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 161 553 | 0,01 | |
| ORACLE CORP 2.40000% 16-15.09.23* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| ORACLE CORP 2.87500% 21-25.03.31* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 469 883 | 0,04 | |
| ORACLE CORP 3.25000% 17-15.11.27* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 423 915 | 0,04 | |
| ORACLE CORP 3.85000% 20-01.04.60* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 256 418 | 0,02 | |
| ORACLE CORP 3.95000% 21-25.03.31* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 205 883 | 0,02 | |
| OVINTIV INC 5.65000% 23-15.05.28* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 274 678 | 0,02 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 20-01.04.56* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 233 281 | 0,02 | |
| PANAMA, REPUBLIC OF 6.40000% 22-14.02.35* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 169 872 | 0,01 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC 2.85000% 19-01.10.29* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 244 352 | 0,02 | |
| PEPSICO INC 1.95000% 21-21.10.31* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 112 291 | 0,01 | |
| PEPSICO INC 4.20000% 22-18.07.52* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 157 351 | 0,01 | |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA-REG-S 4.40000% 22-06.06.27* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 886 118 | 0,07 | |
| PFIZER INC 2.55000% 20-28.05.40* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 193 022 | 0,02 | |
| PFIZER INC 2.62500% 20-01.04.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 240 688 | 0,02 | |
| PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.75000% 23-19.05.33* | USD | | 280 000 | | 280 000 | 248 308 | 0,02 | |
| PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 5.34000% 23-19.05.63* | USD | | 300 000 | 100 000 | 200 000 | 176 516 | 0,01 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 4.87500% 13-15.11.43* | USD | 125 000 | | | 125 000 | 102 847 | 0,01 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 5.12500% 22-17.11.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 362 143 | 0,03 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 2.55000% 20-22.01.30* | USD | 400 000 | 300 000 | | 700 000 | 550 201 | 0,05 | |
| POSCO-REG-S 5.62500% 23-17.01.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 180 414 | 0,01 | |
| PROCTER & GAMBLE CO 3.00000% 20-25.03.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 248 754 | 0,02 | |
| PROCTER & GAMBLE CO 3.55000% 20-25.03.40* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 77 091 | 0,01 | |
| PROGRESSIVE CORP 3.20000% 20-26.03.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 246 499 | 0,02 | |
| PROSUS NV-REG-S 4.98700% 22-19.01.52* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 132 471 | 0,01 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 2.45000% 21-15.11.31* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 223 417 | 0,02 | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 346 049 | 0,03 | |
| QATAR, STATE OF-REG-S 4.40000% 20-16.04.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 159 480 | 0,01 | |
| QATARENERGY-REG-S 2.25000% 21-12.07.31* | USD | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 301 960 | 0,02 | |
| QUALCOMM INC 1.30000% 21-20.05.28* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 78 969 | 0,01 | |
| QUALCOMM INC 4.30000% 17-20.05.47* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 158 825 | 0,01 | |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 161 671 | 0,01 | |
| REPUBLIC OF ITALY GOV INTERN BOND 3.87500% 21-06.05.51* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 128 006 | 0,01 | |
| REPUBLIC SERVICES INC 3.37500% 17-15.11.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 342 427 | 0,03 | |
| RIO TINTO FINANCE USA LTD 7.12500% 08-15.07.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 196 504 | 0,02 | |
| ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 4.98500% 24-08.03.34* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 181 407 | 0,02 | |
| ROMANIAN GOVT INT BND-REG-S 5.25000% 22-25.11.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 355 214 | 0,03 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC 1.00000% 20-15.09.25* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 127 028 | 0,01 | |
| RTX CORP 2.25000% 20-01.07.30* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 153 791 | 0,01 | |
| RTX CORP 3.03000% 21-15.03.52* | USD | 325 000 | | | 325 000 | 193 828 | 0,02 | |
| RTX CORP 4.12500% 18-16.11.28* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 261 370 | 0,02 | |
| SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.62500% 16-01.03.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 269 974 | 0,02 | |
| SALESFORCE.COM INC 1.50000% 21-15.07.28* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 118 837 | 0,01 | |
| SANDS CHINA LTD STEP-UP/DOWN 19-08.08.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 176 666 | 0,01 | |
| SCHLUMBERGER INVESTMENT SA 2.65000% 20-26.06.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 239 359 | 0,02 | |
| SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.12500% 15-11.05.35* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 505 523 | 0,04 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO 3.80000% 19-15.08.49* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 71 000 | 0,01 | |
| SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.87500% 16-23.09.23* | USD | 68 000 | | 68 000 | | | | |
| SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 3.20000% 16-23.09.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 258 453 | 0,02 | |
| SIMON PROPERTY GROUP LP 3.37500% 17-01.12.27* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 341 221 | 0,03 | |
| SIMON PROPERTY GROUP LP 5.85000% 23-08.03.53* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 139 145 | 0,01 | |
| SOUTHERN CO 3.25000% 16-01.07.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 118 | 0,01 | |
| STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 4.05000% 16-12.04.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 175 125 | 0,01 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC 2.75000% 20-15.11.50* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 53 337 | 0,00 | |
| STARBUCKS CORP 3.50000% 20-15.11.50* | USD | 100 000 | 200 000 | | 300 000 | 199 975 | 0,02 | |
| STATE OF ISRAEL-REG-S 3.80000% 20-13.05.60* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 124 297 | 0,01 | |
| STATE STREET CORP 2.40000% 20-24.01.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 317 103 | 0,03 | |
| SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.04000% 19-16.07.29* | USD | 800 000 | | 200 000 | 600 000 | 490 024 | 0,04 | |
| SVENSK EXPORTKREDIT AB 0.50000% 20-26.08.25* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 253 694 | 0,02 | |
| SYSCO CORP 5.95000% 20-01.04.30* | USD | 100 000 | 250 000 | | 350 000 | 328 697 | 0,03 | |
| TARGA RESOURCES CORP 6.12500% 23-15.03.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 187 935 | 0,02 | |
| TARGET CORP 3.50000% 14-01.07.24* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 89 642 | 0,01 | |
| TARGET CORP 4.80000% 23-15.01.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 169 418 | 0,01 | |
| TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27* | USD | 450 000 | | 241 000 | 209 000 | 183 066 | 0,02 | |
| TELEFONICA EMISIONES SA 5.21300% 17-08.03.47* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 165 757 | 0,01 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 3.50000% 12-15.12.42* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 261 316 | 0,02 |
| TEXAS INSTRUMENT INC 4.60000% 22-15.02.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 180 203 | 0,01 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC 5.05000% 23-18.05.63* | USD | | 100 000 | | 100 000 | 87 717 | 0,01 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.79700% 21-18.10.23* | USD | 150 000 | | 150 000 | | | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 5.20000% 23-31.01.34* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 183 713 | 0,02 |
| TIME WARNER CABLE LLC 5.50000% 11-01.09.41* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 224 934 | 0,02 |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.46100% 19-12.07.49* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 135 782 | 0,01 |
| TOYOTA MOTOR CORP 1.33900% 21-25.03.26* | USD | 650 000 | | | 650 000 | 546 304 | 0,05 |
| TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.10000% 20-15.04.30* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 85 061 | 0,01 |
| TRAVELERS COMPANIES INC 3.75000% 16-15.05.46* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 181 555 | 0,02 |
| TSMC ARIZONA CORP 4.25000% 22-22.04.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 889 | 0,01 |
| TYSON FOODS INC 3.95000% 14-15.08.24* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 89 540 | 0,01 |
| UBS GROUP AG 3.75000% 16-26.03.25* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | |
| UBS GROUP AG 3.75000% 23-26.03.25* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 220 927 | 0,02 |
| UBS GROUP AG 4.87500% 23-15.05.45* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 209 294 | 0,02 |
| UBS GROUP AG-REG-S 4.87500% 15-15.05.45* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | |
| UNION PACIFIC CORP 3.79900% 16-01.10.51* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 71 874 | 0,01 |
| UNION PACIFIC CORP 3.37500% 22-14.02.42* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 285 865 | 0,02 |
| UNITED PARCEL SERVICE INC 6.20000% 08-15.01.38* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 199 355 | 0,02 |
| UNITED PARCEL SERVICE INC 2.50000% 19-01.09.29* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | |
| UNITED PARCEL SERVICE INC 3.90000% 20-01.04.25* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 88 904 | 0,01 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC 2.00000% 20-15.05.30* | USD | 300 000 | 300 000 | | 600 000 | 459 295 | 0,04 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC 3.05000% 21-15.05.41* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC 4.75000% 22-15.05.52* | USD | 100 000 | 200 000 | | 300 000 | 250 601 | 0,02 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC 4.95000% 22-15.05.62* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 126 166 | 0,01 |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 15-27.10.27* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 89 282 | 0,01 |
| US BANCORP-SUB 3.00000% 19-30.07.29* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 402 331 | 0,03 |
| VALERO ENERGY CORP 3.65000% 21-01.12.51* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 130 371 | 0,01 |
| VENTAS REALTY LP 2.50000% 21-01.09.31* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 147 973 | 0,01 |
| VENTAS REALTY LP 3.00000% 19-15.01.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.00000% 20-20.11.60* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 168 499 | 0,01 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.55000% 21-22.03.51* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28* | USD | 715 000 | | | 715 000 | 579 770 | 0,05 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.40000% 21-22.03.41* | USD | 450 000 | | | 450 000 | 316 795 | 0,03 |
| VIACOMCBS INC 4.20000% 20-19.05.32* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 299 304 | 0,02 |
| VICI PROPERTIES LP 4.95000% 22-15.02.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 348 410 | 0,03 |
| VIRGINIA ELECTRIC AND POWER CO 2.40000% 22-30.03.32* | USD | 100 000 | 300 000 | | 400 000 | 298 718 | 0,02 |
| VISA INC 4.30000% 15-14.12.45* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 203 077 | 0,02 |
| VMWARE LLC 2.20000% 21-15.08.31* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 183 244 | 0,02 |
| VODAFONE GROUP PLC 5.75000% 23-10.02.63* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 273 156 | 0,02 |
| WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 112 170 | 0,01 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.45000% 16-01.06.26* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | |
| WALMART INC 4.05000% 18-29.06.48* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 78 258 | 0,01 |
| WALT DISNEY CO 2.65000% 20-13.01.31* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 317 180 | 0,03 |
| WALT DISNEY CO 3.60000% 20-13.01.51* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 279 099 | 0,02 |
| WASTE CONNECTIONS INC 5.00000% 24-01.03.34* | USD | | 80 000 | | 80 000 | 71 361 | 0,01 |
| WASTE MANAGEMENT INC 3.15000% 17-15.11.27* | USD | 100 000 | 200 000 | | 300 000 | 256 125 | 0,02 |
| WEC ENERGY GROUP INC 1.37500% 20-15.10.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 158 688 | 0,01 |
| WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 6.15000% 23-01.04.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 184 700 | 0,02 |
| WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.96300% 20-16.11.40* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 63 569 | 0,01 |
| WESTPAC BANKING CORP-SUB 6.82000% 23-17.11.33* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 489 464 | 0,04 |
| WILLIAMS COMPANIES INC 2.60000% 21-15.03.31* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 230 225 | 0,02 |
| WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 352 | 0,01 |
| WRKCO INC 3.00000% 20-15.06.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 152 409 | 0,01 |
| ZOTIS INC 5.60000% 22-16.11.32* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 93 479 | 0,01 |
| TOTAL USD | | | | | | 86 675 581 | 7,17 |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 108 458 596 | 8,97 |

Notes, Nullcoupon

EUR

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|--|-----------|------------------|-------------|
| ALLIANZ FINANCE II BV-REG-S 0.00000% 21-22.11.26* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 269 525 | 0,02 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 20-20.10.40* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 299 122 | 0,02 |
| COMCAST CORP 0.00000% 21-14.09.26* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 268 708 | 0,02 |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.00000% 20-13.10.27* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 617 578 | 0,05 |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 19-15.09.24* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 382 616 | 0,03 |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 21-15.09.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 181 507 | 0,02 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 21-25.11.31* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 795 131 | 0,07 |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-10.10.25* | EUR | 1 000 000 | 1 000 000 | | 2 000 000 | 1 860 898 | 0,15 |
| TOTAL EUR | | | | | | 4 675 086 | 0,39 |
| Total Notes, Nullcoupon | | | | | | 4 675 086 | 0,39 |

| Titel | | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| Notes, variabler Zins | | | | | | | | |
| CAD | | | | | | | | |
| CANADIAN IMPERIAL BK OF COMM-SUB COCO 2.950%/VAR 19-19.06.29* | CAD | 400 000 | | 400 000 | | | | |
| TOTAL CAD | | | | | | | 0,00 | |
| EUR | | | | | | | | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 4.875%/VAR 23-16.07.28* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 100 822 | 0,01 | |
| BARCLAYS PLC-REG-S 0.577%/VAR 21-09.08.29* | EUR | 350 000 | | | 350 000 | 296 187 | 0,02 | |
| CITIGROUP INC-REG-S 4.112%/VAR 22-22.09.33* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 201 288 | 0,02 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG-REG-S-SUB 1.250%/VAR 20-16.06.47* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 88 953 | 0,01 | |
| ENEL SPA-REG-S-SUB 1.375%/VAR 21-PRP* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 259 285 | 0,02 | |
| ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP* | EUR | | 150 000 | | 150 000 | 135 151 | 0,01 | |
| HANNOVER RUECK SE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 22-26.08.43* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 218 980 | 0,02 | |
| HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 0.641%/VAR 21-24.09.29* | EUR | 450 000 | | | 450 000 | 384 238 | 0,03 | |
| IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 1.874%/VAR 20-PRP* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 184 884 | 0,02 | |
| IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 1.825%/VAR 21-PRP* | EUR | 100 000 | 100 000 | | 200 000 | 166 539 | 0,01 | |
| ING GROEP NV-REG-S 0.250%/VAR 21-01.02.30* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 329 823 | 0,03 | |
| MORGAN STANLEY 0.406%/VAR 21-29.10.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 269 260 | 0,02 | |
| MORGAN STANLEY 3.955%/VAR 24-21.03.35* | EUR | | 240 000 | | 240 000 | 236 907 | 0,02 | |
| ORSTED A/S-REG-S-SUB 1.750%/VAR 19-09.12.3019* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 87 619 | 0,01 | |
| SAMPO OYJ-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-03.09.52* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 126 037 | 0,01 | |
| SWEDBANK AB-REG-S 0.300%/VAR 21-20.05.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 180 968 | 0,01 | |
| SWISS RE FIN UK PLC-REG-S-SUB 2.714%/VAR 20-04.06.52* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 86 203 | 0,01 | |
| UBS GROUP AG-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 378 752 | 0,03 | |
| TOTAL EUR | | | | | | 3 731 896 | 0,31 | |
| GBP | | | | | | | | |
| BARCLAYS PLC-REG-S SUB 3.750%/VAR 20-22.11.30* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 218 255 | 0,02 | |
| MORGAN STANLEY 5.789%/VAR 22-18.11.33* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 238 777 | 0,02 | |
| TOTAL GBP | | | | | | 457 032 | 0,04 | |
| USD | | | | | | | | |
| AMERICAN EXPRESS CO 5.282%/VAR 23-27.07.29* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 362 521 | 0,03 | |
| BANCO SANTANDER SA 4.175%/VAR 22-24.03.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 173 629 | 0,01 | |
| BANK OF AMERICA CORP 4.271%/VAR 18-23.07.29* | USD | 1 000 000 | | 400 000 | 600 000 | 520 919 | 0,04 | |
| BANK OF AMERICA CORP 2.551%/VAR 22-04.02.28* | USD | | 700 000 | | 700 000 | 586 053 | 0,05 | |
| BANK OF AMERICA CORP 5.015%/VAR 22-22.07.33* | USD | 400 000 | 250 000 | | 650 000 | 576 239 | 0,05 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA-SUB COCO 4.588%/VAR 22-04.05.37* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 163 295 | 0,01 | |
| BARCLAYS PLC 2.852%/VAR 20-07.05.26* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 611 134 | 0,05 | |
| CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 384 822 | 0,03 | |
| CITIGROUP INC 4.910%/VAR 22-24.05.33* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 260 501 | 0,02 | |
| DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.311%/VAR 21-16.11.27* | USD | 450 000 | | | 450 000 | 370 564 | 0,03 | |
| DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.819%/VAR 23-20.11.29* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 141 239 | 0,01 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.615%/VAR 21-22.04.32* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 75 591 | 0,01 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.542%/VAR 21-10.09.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 246 906 | 0,02 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.102%/VAR 22-24.02.33* | USD | 600 000 | 200 000 | | 800 000 | 616 256 | 0,05 | |
| HSBC HOLDINGS PLC 2.251%/VAR 21-22.11.27* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 498 071 | 0,04 | |
| HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.762%/VAR 22-29.03.33* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 334 851 | 0,03 | |
| ING GROEP NV 4.017%/VAR 22-28.03.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 173 567 | 0,01 | |
| JP MORGAN CHASE & CO 3.882%/VAR 17-24.07.38* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 467 194 | 0,04 | |
| JP MORGAN CHASE & CO 3.328%/VAR 21-22.04.52* | USD | 100 000 | 300 000 | | 400 000 | 261 315 | 0,02 | |
| JPMORGAN CHASE & CO 2.522%/VAR 20-22.04.31* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 467 075 | 0,04 | |
| JPMORGAN CHASE & CO 1.045%/VAR 20-19.11.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 251 942 | 0,02 | |
| JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 500 135 | 0,04 | |
| JPMORGAN CHASE-SUB 5.717%/VAR 22-14.09.33* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 229 670 | 0,02 | |
| LLOYDS BANKING GROUP-SUB 3.369%/VAR 21-14.12.46* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 251 642 | 0,02 | |
| MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.255%/VAR 23-07.12.34* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 188 461 | 0,02 | |
| MACQUARIE GRP LTD-REG-S 1.340%/VAR 21-12.01.27* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 501 242 | 0,04 | |
| METLIFE INC-SUB 6.400%/3M LIBOR+220.5BP 06-15.12.36* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 92 228 | 0,01 | |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 2.341%/VAR 22-19.01.28* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 334 134 | 0,03 | |
| MORGAN STANLEY 2.802%/VAR 21-25.01.52* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 58 966 | 0,00 | |
| MORGAN STANLEY 3.620%/VAR 22-17.04.25* | USD | 700 000 | | 700 000 | | | | |
| MORGAN STANLEY 5.164%/VAR 23-20.04.29* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 449 987 | 0,04 | |
| MORGAN STANLEY 5.424%/VAR 23-21.07.34* | USD | | 80 000 | | 80 000 | 72 279 | 0,01 | |
| MORGAN STANLEY-SUB 5.297%/VAR 22-20.04.37* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 518 478 | 0,04 | |
| NATWEST GROUP PLC 5.808%/VAR 23-13.09.29* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 274 363 | 0,02 | |
| SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 230 310 | 0,02 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.673%/VAR 21-14.06.27* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 164 787 | 0,01 |
| SOCIETE GENERALE SA-144A 2.889%/VAR 21-09.06.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 148 054 | 0,01 |
| SOUTHERN CO/THE-SUB 4.000%/ VAR 20-15.01.51* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 259 770 | 0,02 |
| UBS GROUP AG-144A 5.711%/VAR 23-12.01.27* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 361 392 | 0,03 |
| WABTEC CORP/DE STEP-UP/RATING LINKED 18-15.03.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.894%/VAR 20-04.02.30* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 12 179 582 | 1,01 |
| Total Notes, variabler Zins | | | | | | 16 368 510 | 1,35 |

Medium-Term Notes, fester Zins

AUD

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|--|---------|------------------|-------------|
| AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 2.60000% 19-31.07.29* | AUD | 100 000 | | | 100 000 | 51 324 | 0,00 |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.80000% 22-19.01.27* | AUD | 400 000 | | | 400 000 | 220 533 | 0,02 |
| LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 3.25000% 17-12.04.28* | AUD | 300 000 | | | 300 000 | 170 083 | 0,01 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 4.25000% 17-22.11.27* | AUD | 100 000 | | | 100 000 | 56 674 | 0,00 |
| NEW SOUTH WALES TREASURY CORP-REG-S 4.00000% 14-20.05.26* | AUD | 800 000 | | | 800 000 | 470 672 | 0,04 |
| SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR-REG-S 2.25000% 16-15.08.24* | AUD | 400 000 | | | 400 000 | 233 256 | 0,02 |
| TREASURY CORP OF VICTORIA-REG-S 3.00000% 15-20.10.28* | AUD | 400 000 | 400 000 | | 800 000 | 450 077 | 0,04 |
| TREASURY CORP OF VICTORIA 1.50000% 20-10.09.31* | AUD | 700 000 | | | 700 000 | 335 782 | 0,03 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 4.50000% 17-17.08.27* | AUD | 200 000 | | | 200 000 | 116 345 | 0,01 |
| TOTAL AUD | | | | | | 2 104 744 | 0,17 |

EUR

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|---------|---------|---------|------|
| AAREAL BANK AG-REG-S 0.12500% 22-01.02.30* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 161 637 | 0,01 |
| ABB FINANCE BV-REG-S 0.75000% 17-16.05.24* | EUR | 200 000 | | 200 000 | | | |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA-REG-S 3.00000% 19-27.03.31* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 503 | 0,01 |
| ABN AMRO BANK NV-REG-S 0.87500% 19-15.01.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.37500% 22-01.06.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 282 792 | 0,02 |
| AFRICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 22-14.09.29* | EUR | | 233 000 | | 233 000 | 220 762 | 0,02 |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.25000% 19-29.06.29* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 252 396 | 0,02 |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOP EPIC-REG-S 3.37500% 23-25.05.33* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 297 163 | 0,02 |
| AIR LIQUIDE FINANCE SA-REG-S 1.87500% 14-05.06.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| AIR LIQUIDE FINANCE-REG-S 0.37500% 21-20.09.33* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 151 969 | 0,01 |
| AIRBUS SE-REG-S 2.37500% 20-09.06.40* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 166 207 | 0,01 |
| ALLIANZ FINANCE II BV-REG-S 0.50000% 20-14.01.31* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 82 525 | 0,01 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 2.00000% 18-23.01.35* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 85 282 | 0,01 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.12500% 19-01.07.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 273 690 | 0,02 |
| ARKEMA SA-REG-S 3.50000% 23-23.01.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 194 062 | 0,02 |
| AROUNDTOWN SA-REG-S 0.37500% 21-15.04.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 162 767 | 0,01 |
| ASB BANK LTD-REG-S 4.50000% 23-16.03.27* | EUR | 115 000 | | | 115 000 | 114 960 | 0,01 |
| ASTM SPA-REG-S 1.62500% 18-08.02.28* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 180 674 | 0,01 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.10000% 17-20.09.2117* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 74 996 | 0,01 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.75000% 18-20.02.28* | EUR | | 900 000 | 900 000 | | | |
| BADEN-WUERTEMBERG, STATE OF-REG-S 0.62500% 15-03.02.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 939 | 0,01 |
| BALDER FINLAND OYJ-REG-S 1.00000% 21-20.01.29* | EUR | 150 000 | | 150 000 | | | |
| BANCA INTESA SPA-REG-S 1.35000% 21-24.02.31* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 247 265 | 0,02 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S 1.37500% 18-14.05.25* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 473 640 | 0,04 |
| BANCO BPM SPA-REG-S 3.75000% 23-27.06.28* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 197 131 | 0,02 |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 2.12500% 18-08.02.28* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 274 873 | 0,02 |
| BANK OF MONTREAL-REG-S 0.10000% 16-20.10.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUE-REG-S-SUB 1.87500% 19-18.06.29* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 353 509 | 0,03 |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUE-REG-S 1.00000% 22-23.05.25* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 282 994 | 0,02 |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 4.37500% 23-02.05.30* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 302 132 | 0,02 |
| BASF SE-REG-S 0.75000% 22-17.03.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 184 997 | 0,02 |
| BAT CAPITAL CORP-REG-S 1.12500% 17-16.11.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| BAYER AG-REG-S 4.62500% 23-26.05.33* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 100 400 | 0,01 |
| BAYERISCHE LANDESBANK-REG-S 0.20000% 22-20.05.30* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 331 360 | 0,03 |
| BELFIUS BANK SA-REG-S 0.12500% 20-28.01.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 82 412 | 0,01 |
| BERLIN HYP AG-REG-S 0.37500% 21-21.04.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 152 913 | 0,01 |
| BMW FINANCE NV-REG-S 0.75000% 16-15.04.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| BMW FINANCE NV-REG-S 1.50000% 19-06.02.29* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 224 780 | 0,02 |
| BMW FINANCE NV-REG-S 3.25000% 23-22.07.30* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 196 749 | 0,02 |
| BNG BANK NV -REG-S 1.87500% 22-13.07.32* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 599 | 0,01 |
| BNG BANK NV-REG-S 0.87500% 16-24.10.36* | EUR | 400 000 | 200 000 | | 600 000 | 455 663 | 0,04 |
| BNG BANK NV-REG-S 1.12500% 14-04.09.24* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 96 201 | 0,01 |
| BNG BANK NV-REG-S 3.50000% 23-27.09.38* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 101 263 | 0,01 |
| BNP PARIBAS HOME LOAN SFH SA-REG-S 3.00000% 23-25.05.28* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 292 328 | 0,02 |
| BNP PARIBAS-REG-S 2.10000% 22-07.04.32* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 259 794 | 0,02 |
| BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 2.21300% 14-25.09.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 903 | 0,01 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--|--------------------|---------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | | |
| BPCE SA-REG-S 0.50000% 19-24.02.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 178 197 | 0,01 | |
| BPCE SA-REG-S 3.87500% 24-11.01.29* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 390 675 | 0,03 | |
| BPCE SFH SA-REG-S 1.75000% 14-27.06.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-REG-S 1.50000% 17-23.06.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 274 622 | 0,02 | |
| BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-26.03.35* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 182 610 | 0,02 | |
| CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.50000% 22-25.05.32* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 351 486 | 0,03 | |
| CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 3.12500% 23-01.03.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 98 854 | 0,01 | |
| CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 2.87500% 22-25.05.27* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 388 347 | 0,03 | |
| CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 3.90000% 11-20.10.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| CAIXABANK SA-REG-S 1.12500% 17-17.05.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| CAIXABANK SA-REG-S 4.37500% 23-29.11.33* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 102 655 | 0,01 | |
| CARLSBERG BREWERIES AS-REG-S 4.00000% 23-05.10.28* | EUR | | 145 000 | | 145 000 | 144 816 | 0,01 | |
| CARREFOUR SA-REG-S 0.75000% 16-26.04.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| CARREFOUR SA-REG-S 4.37500% 23-14.11.31* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 102 145 | 0,01 | |
| CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA-REG-S 3.12500% 23-17.05.29* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 195 897 | 0,02 | |
| CIE DE SAINT-GOBAIN SA-REG-S 1.37500% 17-14.06.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 604 | 0,01 | |
| CIE DE SAINT-GOBAIN-REG-S 2.62500% 22-10.08.32* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 183 649 | 0,02 | |
| CIE FIN & INDUSTRIELLE DES AUTO-REG-S 1.12500% 17-13.10.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 757 | 0,01 | |
| COCA-COLA HBC FINANCE BV-REG-S 3.37500% 24-27.02.28* | EUR | | 110 000 | | 110 000 | 107 212 | 0,01 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 0.87500% 18-18.04.28* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 89 667 | 0,01 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 0.37500% 20-01.09.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 266 123 | 0,02 | |
| COMMERZBANK AG-REG-S 2.25000% 22-01.09.32* | EUR | 225 000 | | | 225 000 | 208 465 | 0,02 | |
| COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S 0.87500% 19-19.02.29* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 87 383 | 0,01 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 1.25000% 16-24.03.31* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 260 544 | 0,02 | |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.50000% 18-19.02.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 509 | 0,01 | |
| CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.87500% 16-20.12.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 186 718 | 0,02 | |
| CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.00000% 22-18.09.25* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 656 913 | 0,05 | |
| CREDIT MUTUEL ARKEA SAC-REG-S 0.87500% 21-25.10.31* | EUR | 100 000 | | 200 000 | 300 000 | 240 438 | 0,02 | |
| CREDIT MUTUEL HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.62500% 22-04.03.27* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 362 636 | 0,03 | |
| CRH FUNDING BV-REG-S 1.87500% 15-09.01.24* | EUR | 150 000 | | 150 000 | | | | |
| CRH SMW FINANCE DAC-REG-S 4.25000% 23-11.07.35* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 203 750 | 0,02 | |
| CYPRUS GOVERNMENT BOND-REG-S 1.25000% 20-21.01.40* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 70 032 | 0,01 | |
| DAIMLER AG-REG-S 2.00000% 20-22.08.26* | EUR | 350 000 | | | 350 000 | 331 200 | 0,03 | |
| DAIMLER AG-REG-S 2.12500% 17-03.07.37* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 85 961 | 0,01 | |
| DANONE SA-REG-S 1.25000% 15-30.05.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| DANSKE BANK AS-REG-S 0.75000% 17-22.11.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 89 563 | 0,01 | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.00000% 18-17.12.27* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 90 552 | 0,01 | |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.75000% 20-16.07.35* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 298 712 | 0,02 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG-S 3.12500% 23-19.05.33* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 98 877 | 0,01 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 190 654 | 0,02 | |
| DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.01000% 21-25.08.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 89 103 | 0,01 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG-S 2.87500% 12-11.12.24* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 145 161 | 0,01 | |
| DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN BV-REG-S 2.00000% 18-01.12.29* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 084 | 0,01 | |
| DZ HYP AG-REG-S 0.01000% 21-29.03.30* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 574 355 | 0,05 | |
| E.ON SE-REG-S 3.75000% 23-01.03.29* | EUR | | 215 000 | | 215 000 | 213 691 | 0,02 | |
| EDP FINANCE BV-REG-S 1.87500% 17-29.09.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| EDP FINANCE BV-REG-S 0.37500% 19-16.09.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 180 641 | 0,01 | |
| EIKA BOLIGKREDIT AS 0.01000% 20-12.03.27* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 133 261 | 0,01 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 4.62500% 09-11.09.24* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 292 681 | 0,02 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 2.00000% 19-09.12.49* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 128 664 | 0,01 | |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.87500% 21-17.06.36* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 140 357 | 0,01 | |
| ENGIE SA-REG-S 1.75000% 20-27.03.28* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 183 032 | 0,02 | |
| ENGIE SA-REG-S 2.37500% 14-19.05.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 190 548 | 0,02 | |
| ENI SPA-REG-S 0.37500% 21-14.06.28* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 343 483 | 0,03 | |
| ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 3.12500% 23-14.10.27* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 389 025 | 0,03 | |
| ESSILORLUXOTTICA SA-REG-S 0.37500% 19-27.11.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 88 286 | 0,01 | |
| EUROFIMA EURO RAILROADMAT FIN CO-REG-S 0.15000% 19-10.10.34* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 73 787 | 0,01 | |
| EUROGRID GMBH-REG-S 3.72200% 23-27.04.30* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 197 012 | 0,02 | |
| EUROPEAN COMMUNITY-REG-S 0.45000% 21-02.05.46* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 399 675 | 0,03 | |
| EUROPEAN COMMUNITY-REG-S 0.45000% 21-04.07.41* | EUR | | 1 200 000 | 400 000 | 800 000 | 502 640 | 0,04 | |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 3.87500% 12-30.03.32* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 736 956 | 0,06 | |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.70000% 17-13.02.43* | EUR | 300 000 | 300 000 | | 600 000 | 473 278 | 0,04 | |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 2.00000% 17-28.02.56* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 76 314 | 0,01 | |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.37500% 17-11.10.24* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 191 311 | 0,02 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.00000% 10-15.04.30* | EUR | 400 000 | 400 000 | | 800 000 | 835 194 | 0,07 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.75000% 13-15.03.40* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 378 892 | 0,03 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.25000% 16-14.09.29* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 426 975 | 0,04 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.12500% 17-13.04.33* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 169 713 | 0,01 | |
| EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 1.85000% 15-01.12.55* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 109 118 | 0,01 | |
| EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.75000% 18-05.09.28* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 625 433 | 0,05 | |
| EUROPEAN UNION-REG-S 3.00000% 11-04.09.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 195 152 | 0,02 | |

| Titel | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|---------------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Käufe ¹ | Verkäufe ² | | | |
| EUROPEAN UNION-REG-S 3.37500% 23-04.10.38* | EUR | | 75 000 | 75 000 | 75 331 | 0,01 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 2.75000% 23-05.10.26* | EUR | | 1 000 000 | 1 000 000 | 969 056 | 0,08 |
| EVONIK FINANCE BV-REG-S 0.75000% 16-07.09.28* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 177 125 | 0,01 |
| EXPORT DEVELOPMENT CANADA-REG-S 0.50000% 22-25.02.27* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 90 747 | 0,01 |
| FERROVIE DELLO STATO-REG-S 1.50000% 17-27.06.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 94 692 | 0,01 |
| FINNVERA OYJ-REG-S 2.12500% 22-08.03.28* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 284 898 | 0,02 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG-REG-S 1.50000% 20-29.05.30* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 85 164 | 0,01 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.87500% 14-03.06.26* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 192 781 | 0,02 |
| HEIDELBERGCEMENT FIN LUX SA-REG-S 1.62500% 17-07.04.26* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 93 734 | 0,01 |
| HEINEKEN NV-REG-S 2.87500% 12-04.08.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 96 322 | 0,01 |
| HEINEKEN NV-REG-S 2.25000% 20-30.03.30* | EUR | | 300 000 | 300 000 | 276 917 | 0,02 |
| HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE TRAN-REG-S 1.47500% 22-18.01.31* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 168 722 | 0,01 |
| ILE DE FRANCE-REG-S 0.50000% 16-14.06.25* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 280 999 | 0,02 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG-REG-S 1.62500% 20-24.06.29* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 89 525 | 0,01 |
| ING BANK NV-REG-S 0.87500% 18-11.04.28* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 268 968 | 0,02 |
| ING GROEP NV-REG-S 1.12500% 18-14.02.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 95 139 | 0,01 |
| ING-DIBA AG-REG-S 0.01000% 21-07.10.28* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 85 362 | 0,01 |
| INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.10000% 20-17.09.35* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 142 806 | 0,01 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.87500% 19-31.01.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 95 012 | 0,01 |
| ITALGAS SPA-REG-S 0.87500% 19-24.04.30* | EUR | 250 000 | | 250 000 | 209 117 | 0,02 |
| KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24* | EUR | 200 000 | 200 000 | | | |
| KBC GROUP NV-REG-S 3.00000% 22-25.08.30* | EUR | | 400 000 | 400 000 | 376 651 | 0,03 |
| KERING SA-REG-S 3.62500% 23-05.09.31* | EUR | | 300 000 | 300 000 | 297 009 | 0,02 |
| KLEPIERRE SA-REG-S 1.87500% 16-19.02.26* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 94 126 | 0,01 |
| KOMMUNEKREDIT-REG-S 0.01000% 20-04.05.34* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 146 940 | 0,01 |
| KONINKLIJKE KPN NV-REG-S 0.87500% 21-15.11.33* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 77 305 | 0,01 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30* | EUR | 150 000 | 300 000 | 450 000 | 382 450 | 0,03 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.50000% 14-11.06.24* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 193 643 | 0,02 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.87500% 19-04.07.39* | EUR | 300 000 | 100 000 | 400 000 | 292 499 | 0,02 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.12500% 22-09.01.32* | EUR | 200 000 | 300 000 | 500 000 | 400 441 | 0,03 |
| LA BANQUE POSTALE-REG-S-SUB 3.00000% 16-09.06.28* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 189 278 | 0,02 |
| LANDESBANK BADEN-WUERTEMBERG-REG-S 0.37500% 20-18.02.27* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 263 203 | 0,02 |
| LANDESBANK BADEN-WUERTEMBERG-REG-S 0.01000% 20-17.06.26* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 90 852 | 0,01 |
| LANDESBANK HESSEN-THUERINGE GIROZ-REG-S 0.01000% 22-19.07.27* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 264 751 | 0,02 |
| LEASEPLAN CORP NV-REG-S 0.25000% 21-07.09.26* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 179 267 | 0,01 |
| LINDE FINANCE BV-REG-S 1.00000% 16-20.04.28* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 90 250 | 0,01 |
| LINDE PLC-REG-S 1.37500% 22-31.03.31* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 259 821 | 0,02 |
| LITHUANIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.95000% 17-26.05.27* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 90 165 | 0,01 |
| LITHUANIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.62500% 19-19.06.49* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 64 775 | 0,01 |
| LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 2.37500% 20-09.04.26* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 142 723 | 0,01 |
| LLOYDS BANK PLC-REG-S 0.62500% 18-26.03.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 94 474 | 0,01 |
| LLOYDS BANK PLC-REG-S 3.25000% 23-02.02.26* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 291 020 | 0,02 |
| LONDON STOCK EX GROUP PLC-REG-S 1.75000% 18-06.12.27* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 185 022 | 0,02 |
| MCDONALD'S CORP-REG-S 1.50000% 17-28.11.29* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 176 219 | 0,01 |
| MCDONALD'S CORP-REG-S 3.87500% 23-20.02.31* | EUR | | 200 000 | 200 000 | 199 663 | 0,02 |
| MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH-REG-S 0.12500% 20-16.07.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 93 207 | 0,01 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA-REG-S 1.87500% 16-02.11.26* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 186 641 | 0,02 |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP-REG-S 1.63100% 22-08.04.27* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 276 026 | 0,02 |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.50000% 15-14.03.25* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 94 447 | 0,01 |
| MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 1.25000% 18-23.02.33* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 85 410 | 0,01 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.75000% 19-30.01.26* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 92 762 | 0,01 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 3.26270% 23-13.02.26* | EUR | | 300 000 | 300 000 | 291 062 | 0,02 |
| NATIONAL GRID TRANSCO PLC-REG-S 0.75000% 21-01.09.33* | EUR | 250 000 | 250 000 | 500 000 | 372 711 | 0,03 |
| NATURGY FINANCE BV-REG-S 1.25000% 20-15.01.26* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 186 361 | 0,02 |
| NATWEST MARKETS PLC-REG-S 2.00000% 22-27.08.25* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 285 124 | 0,02 |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 0.75000% 16-04.10.41* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 131 336 | 0,01 |
| NORDEA BANK ABP-REG-S 1.12500% 22-16.02.27* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 136 781 | 0,01 |
| NORDEA MORTGAGE BANK PLC-REG-S 0.12500% 19-18.06.27* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 265 709 | 0,02 |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.15000% 19-21.03.19* | EUR | 50 000 | | 50 000 | 36 406 | 0,00 |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 0.20000% 21-27.01.51* | EUR | 320 000 | | 320 000 | 149 253 | 0,01 |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 0.60000% 21-04.06.41* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 98 518 | 0,01 |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 3.40000% 23-07.03.73* | EUR | | 150 000 | 150 000 | 159 416 | 0,01 |
| NRW BANK-REG-S 0.50000% 21-17.06.41* | EUR | 250 000 | | 250 000 | 159 533 | 0,01 |
| OMV AG-REG-S 3.50000% 12-27.09.27* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 196 105 | 0,02 |
| ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-REG-S 0.10000% 21-19.05.28* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 172 131 | 0,01 |
| ONTARIO, PROVINCE OF-REG-S 0.01000% 20-25.11.30* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 160 450 | 0,01 |
| OP CORPORATE BANK PLC 0.25000% 21-24.03.26* | EUR | 150 000 | | 150 000 | 136 660 | 0,01 |
| ORANGE SA-REG-S 0.75000% 21-29.06.34* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 152 333 | 0,01 |
| ORANGE SA-REG-S 1.37500% 18-20.03.28* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 181 662 | 0,02 |
| POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.87500% 15-10.05.27* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 182 464 | 0,02 |
| POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.75000% 22-25.05.32* | EUR | 300 000 | | 300 000 | 277 883 | 0,02 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | |
| PROLOGIS EURO FINANCE LLC 4.25000% 23-31.01.43* | EUR | | 150 000 | | 150 000 | 146 972 | 0,01 |
| PROSUS NV-REG-S 1.28800% 21-13.07.29* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 81 955 | 0,01 |
| RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.37500% 15-03.02.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 830 | 0,01 |
| RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 17-31.05.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 2.87500% 23-19.01.33* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 291 862 | 0,02 |
| RCI BANQUE SA-REG-S 1.75000% 19-10.04.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 186 537 | 0,02 |
| RECKITT BENCKISER TREASURY PLC-REG-S 3.62500% 23-14.09.28* | EUR | | 250 000 | | 250 000 | 244 601 | 0,02 |
| RENTOKIL INITIAL FINANCE BV-REG-S 4.37500% 22-27.06.30* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 204 090 | 0,02 |
| ROBERT BOSCH GMBH-REG-S 4.00000% 23-02.06.35* | EUR | | 200 000 | 200 000 | | | |
| ROMANIA-REG-S 2.87500% 14-28.10.24* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 96 699 | 0,01 |
| ROMANIA-REG-S 3.37500% 18-08.02.38* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 462 728 | 0,04 |
| ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.00000% 21-14.04.33* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 299 001 | 0,02 |
| ROMANIAN GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.12500% 22-07.03.28* | EUR | 450 000 | | | 450 000 | 402 447 | 0,03 |
| ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.05000% 19-19.06.26* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 271 786 | 0,02 |
| RWE AG-REG-S 2.75000% 22-24.05.30* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 186 445 | 0,02 |
| SANOFI-REG-S 1.37500% 18-21.03.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 88 612 | 0,01 |
| SANTANDER UK PLC-REG-S 0.05000% 20-12.01.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 267 120 | 0,02 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 1.50000% 15-08.09.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.25000% 23-12.06.28* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 294 593 | 0,02 |
| SFIL SA-REG-S 2.87500% 23-18.01.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 289 650 | 0,02 |
| SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.12500% 19-08.11.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 174 815 | 0,01 |
| SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 1.37500% 18-06.09.30* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 264 762 | 0,02 |
| SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 0.50000% 20-20.02.32* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 1.75000% 22-11.11.26* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 280 017 | 0,02 |
| SNAM SPA-REG-S 0.87500% 16-25.10.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 277 | 0,01 |
| SNAM SPA-REG-S 3.87500% 24-19.02.34* | EUR | | 180 000 | | 180 000 | 176 295 | 0,01 |
| SNCF RESEAU EPIC-REG-S 2.25000% 17-20.12.47* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 151 093 | 0,01 |
| SNCF RESEAU-REG-S 1.12500% 15-25.05.30* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 347 684 | 0,03 |
| SNCF RESEAU-REG-S 4.25000% 11-07.10.26* | EUR | 600 000 | | 600 000 | | | |
| SOCIETE DES GRANDS PROJETS EPIC-REG-S 0.87500% 21-10.05.46* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 174 895 | 0,01 |
| SOCIETE DES GRANDS PROJETS EPIC-REG-S 1.62500% 22-08.04.42* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 73 278 | 0,01 |
| SOCIETE GENERALE SA -REG-S 2.62500% 22-30.05.29* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 376 001 | 0,03 |
| SOCIETE GENERALE SFH-REG-S 0.75000% 18-19.01.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 268 220 | 0,02 |
| SOCIETE GENERALE-REG-S 1.75000% 19-22.03.29* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 88 905 | 0,01 |
| SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 0.62500% 20-17.04.30* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 168 402 | 0,01 |
| SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 4.62500% 09-02.02.24* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.60000% 19-31.10.29* | EUR | 1 400 000 | | | 1 400 000 | 1 206 617 | 0,10 |
| SPAREBANK 1 BOLIGKREDIT AS-REG-S 1.75000% 22-11.05.32* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 265 524 | 0,02 |
| SSE PLC-REG-S 1.75000% 15-08.09.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| STATE OF NORTH RHINE-WESTPHE GER-REG-S 1.45000% 22-19.01.22* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 158 491 | 0,01 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 3.75000% 23-05.05.26* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 293 645 | 0,02 |
| SWEDBANK HYPOTEK AB-REG-S 0.50000% 19-05.02.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 413 | 0,01 |
| TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 1.46000% 16-13.04.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 93 557 | 0,01 |
| TELENOVA ASA-REG-S 0.25000% 20-14.02.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 259 960 | 0,02 |
| TELIA CO AB-REG-S 1.62500% 15-23.02.35* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 123 368 | 0,01 |
| TENNET HOLDING BV-REG-S 1.75000% 15-04.06.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 282 570 | 0,02 |
| TESCO CORP TREAS SER PLC-REG-S 4.25000% 23-27.02.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 201 224 | 0,02 |
| THALES SA-REG-S 4.25000% 23-18.10.31* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 205 180 | 0,02 |
| THUERINGEN, STATE OF 0.50000% 22-02.03.29* | EUR | 202 000 | | | 202 000 | 176 585 | 0,01 |
| TORONTO-DOMINION BANK/THE-REG-S 1.70700% 22-28.07.25* | EUR | 550 000 | | | 550 000 | 523 171 | 0,04 |
| TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.49100% 20-08.04.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 184 512 | 0,02 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 3.85000% 23-24.07.30* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 199 645 | 0,02 |
| TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD-REG-S 3.97400% 24-12.03.36* | EUR | | 135 000 | | 135 000 | 132 822 | 0,01 |
| TRENA RETE ELECTRICA NAZ SPA-REG-S 0.37500% 20-25.09.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 80 066 | 0,01 |
| UNEDIC ASSEO-REG-S 0.50000% 19-20.03.29* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 434 422 | 0,04 |
| UNEDIC ASSEO-REG-S 0.01000% 21-25.05.31* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 159 511 | 0,01 |
| UNEDIC ASSEO-REG-S 1.50000% 17-20.04.32* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 88 168 | 0,01 |
| UNEDIC ASSEO-REG-S 1.75000% 22-25.11.32* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 89 248 | 0,01 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S 2.00000% 20-29.06.32* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 170 489 | 0,01 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S 1.37500% 20-04.12.31* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 81 647 | 0,01 |
| UNICREDIT BANK AUSTRIA AG-REG-S 0.25000% 20-21.06.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 82 107 | 0,01 |
| UNICREDIT BANK GMBH-REG-S 0.01000% 19-19.11.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 261 709 | 0,02 |
| UNICREDIT SPA-REG-S 0.85000% 21-19.01.31* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 323 795 | 0,03 |
| UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 1.12500% 18-12.02.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 091 | 0,01 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 0.38700% 22-17.03.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 274 | 0,01 |
| VATTENFALL AB-REG-S 0.50000% 19-24.06.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 047 | 0,01 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT-REG-S 1.59000% 15-10.01.28* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 674 | 0,01 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S 1.50000% 17-03.04.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 178 366 | 0,01 |
| VINCI SA-REG-S 1.62500% 19-18.01.29* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 272 165 | 0,02 |
| VODAFONE GROUP PLC-REG-S 2.20000% 16-25.08.26* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 142 163 | 0,01 |
| WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 253 014 | 0,02 |
| TOTAL EUR | | | | | | 50 259 441 | 4,16 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| GBP | | | | | | | |
| ANNINGTON FUNDING PLC-REG-S 2.30800% 21-06.10.32* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 178 590 | 0,01 | |
| AT&T INC 7.00000% 09-30.04.40* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 260 351 | 0,02 | |
| BANQUE FEDERATIVE DUCREDIT MUTUEL-REG-S 1.00000% 21-16.07.26* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 104 241 | 0,01 | |
| BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 4.00000% 13-04.09.26* | GBP | 200 000 | | 200 000 | | | |
| CITIGROUP INC-SUB 4.50000% 06-03.03.31* | GBP | 50 000 | | 50 000 | 53 376 | 0,00 | |
| CLARION FUNDING PLC-REG-S 1.87500% 20-22.01.35* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 83 687 | 0,01 | |
| E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 6.12500% 09-06.07.39* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 242 285 | 0,02 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 5.50000% 11-17.10.41* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 213 116 | 0,02 | |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.00000% 20-20.10.27* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 200 439 | 0,02 | |
| ENGIE SA-REG-S 5.00000% 10-01.10.60* | GBP | | 150 000 | 150 000 | 158 313 | 0,01 | |
| EVERSHOLT FUNDING PLC-REG-S 2.74200% 20-30.06.40* | GBP | | 100 000 | 100 000 | | | |
| GATWICK FUNDING LTD-REG-S 2.50000% 21-15.04.30* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 99 334 | 0,01 | |
| HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 5.87500% 11-13.05.41* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 118 100 | 0,01 | |
| INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 20-22.07.27* | GBP | 150 000 | | 150 000 | 152 671 | 0,01 | |
| INTERNATIONAL FINANCE CORP 4.12500% 22-28.11.25* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 225 420 | 0,02 | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 1.37500% 19-09.12.24* | GBP | 500 000 | | 500 000 | 554 597 | 0,05 | |
| KUNTARAHOITUS OYJ-REG-S 1.12500% 22-19.06.25* | GBP | 300 000 | | 300 000 | 326 294 | 0,03 | |
| LAND SECURITIES CAPITAL MARKETS-REG-S 2.39900% 17-08.02.29* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 204 723 | 0,02 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 2.25000% 17-16.10.24* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 111 772 | 0,01 | |
| MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 2.37500% 19-03.07.39* | GBP | 150 000 | | 150 000 | 122 762 | 0,01 | |
| NATIONAL GRID GAS PLC-REG-S 1.12500% 21-14.01.33* | GBP | 200 000 | | 200 000 | | | |
| NESTLE HOLDINGS-REG-S 2.12500% 22-04.04.27* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 106 335 | 0,01 | |
| NETWORK RAIL INFRASTRUC FIN PLC-REG-S 4.37500% 05-09.12.30* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 115 520 | 0,01 | |
| ORANGE-REG-S 5.37500% 10-22.11.50* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 117 352 | 0,01 | |
| ORSTED AS-REG-S 5.12500% 22-13.09.34* | GBP | 200 000 | | 200 000 | 225 664 | 0,02 | |
| RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 5.25000% 12-14.09.27* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 114 162 | 0,01 | |
| SEVERN TRENT WATER UTILITIES FNC-REG-S 3.62500% 13-16.01.26* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 111 036 | 0,01 | |
| SMITHKLINE BEECHAM CAPITAL PLC 5.25000% 01-19.12.33* | GBP | 82 000 | | 82 000 | 98 723 | 0,01 | |
| SOUTHERN WATER SERV FINANCE LTD-REG-S 3.00000% 20-28.05.37* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 81 974 | 0,01 | |
| TELEFONICA EMISIONES SAU-REG-S 5.44500% 10-08.10.29* | GBP | 50 000 | | 50 000 | 58 193 | 0,00 | |
| THAMES WATER UTILITIES FINANCE-REG-S 2.37500% 20-22.04.40* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 67 089 | 0,01 | |
| VODAFONE GROUP PLC-REG-S 3.00000% 16-12.08.56* | GBP | | 100 000 | 100 000 | 70 578 | 0,01 | |
| TOTAL GBP | | | | | 4 576 696 | 0,38 | |
| SEK | | | | | | | |
| KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 0.75000% 20-12.05.28* | SEK | | 5 000 000 | 5 000 000 | 384 641 | 0,03 | |
| LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.50000% 21-20.09.28* | SEK | 5 000 000 | | 5 000 000 | 375 216 | 0,03 | |
| NORDEA HYPOTEK AB-REG-S 1.00000% 21-16.06.27* | SEK | 6 000 000 | | 6 000 000 | 472 050 | 0,04 | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BKEN AB-REG-S 0.50000% 21-16.12.26* | SEK | 4 000 000 | | 4 000 000 | 313 318 | 0,03 | |
| STADSHYPOTEK AB-REG-S 2.00000% 18-01.09.28* | SEK | 2 000 000 | 2 000 000 | 4 000 000 | 321 143 | 0,03 | |
| STADSHYPOTEK AB-REG-S 1.00000% 20-03.09.25* | SEK | 2 000 000 | | 2 000 000 | 162 669 | 0,01 | |
| SWEDBANK HYPOTEK AB-REG-S 1.00000% 21-17.03.27* | SEK | 5 000 000 | | 5 000 000 | 395 276 | 0,03 | |
| TOTAL SEK | | | | | 2 424 313 | 0,20 | |
| SGD | | | | | | | |
| HOUSING & DEVELOPMENT BOARD-REG-S 3.22000% 14-01.12.26* | SGD | | 250 000 | 250 000 | 165 911 | 0,01 | |
| HOUSING & DEVELOPMENT BOARD-REG-S 1.97100% 22-25.01.29* | SGD | 250 000 | | 250 000 | 156 990 | 0,01 | |
| TOTAL SGD | | | | | 322 902 | 0,03 | |
| USD | | | | | | | |
| 3M CO 4.00000% 18-14.09.48* | USD | 200 000 | | 200 000 | 144 685 | 0,01 | |
| AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-22.07.26* | USD | 100 000 | | 100 000 | 82 669 | 0,01 | |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP 0.75000% 21-09.08.24* | USD | 450 000 | | 450 000 | | | |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP 5.85000% 23-04.10.30* | USD | | 500 000 | 500 000 | 471 022 | 0,04 | |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 20-24.01.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | 157 084 | 0,01 | |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-04.02.26* | USD | 400 000 | | 400 000 | 333 435 | 0,03 | |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 22-20.01.27* | USD | 600 000 | | 600 000 | 497 627 | 0,04 | |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.25000% 23-09.01.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 178 569 | 0,01 | |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.12500% 24-12.01.34* | USD | | 500 000 | 500 000 | 441 700 | 0,04 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC 2.45000% 20-15.01.31* | USD | 100 000 | | 100 000 | 77 414 | 0,01 | |
| BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.20000% 14-26.08.24* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | |
| BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25* | USD | 500 000 | | 500 000 | 443 271 | 0,04 | |
| BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27* | USD | 200 000 | | 200 000 | 174 858 | 0,01 | |
| BANK OF CHINA LTD-FRANKFURT-REG-S 3.12500% 22-16.06.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | 351 151 | 0,03 | |
| BANK OF MONTREAL 1.50000% 22-10.01.25* | USD | 400 000 | | 400 000 | 349 618 | 0,03 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP-SUB 3.00000% 16-30.10.28* | USD | 100 000 | | 100 000 | 83 009 | 0,01 | |
| BNG BANK NV-REG-S 0.87500% 21-18.05.26* | USD | 500 000 | | 500 000 | 415 314 | 0,03 | |
| BNP PARIBAS-144A 3.80000% 17-10.01.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.25000% 21-28.10.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 331 044 | 0,03 |
| CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE-REG-S 4.25000% 24-24.01.27* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 446 443 | 0,04 |
| CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 0.80000% 20-13.11.25* | USD | 550 000 | | | 550 000 | 463 563 | 0,04 |
| CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.01500% 22-11.01.27* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 208 094 | 0,02 |
| DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 1.87500% 16-01.09.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 167 982 | 0,01 |
| EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEV 0.50000% 21-28.01.26* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 124 997 | 0,01 |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 4.37500% 23-24.04.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 175 805 | 0,01 |
| HONG KONG GOVERNMENT INTER BOND-REG-S 1.37500% 21-02.02.31* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 148 693 | 0,01 |
| INDUS&COMM BANK OF CH LTD/HK-REG-S 2.95000% 22-01.06.25* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 175 377 | 0,01 |
| INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 299 676 | 0,02 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.75000% 20-09.03.27* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 82 691 | 0,01 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.95000% 23-14.07.28* | USD | | 100 000 | | 100 000 | 90 749 | 0,01 |
| KOMMUNALBANKEN A/S-REG-S 1.12500% 21-26.10.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 164 783 | 0,01 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 1.62500% 22-10.05.24* | USD | 500 000 | | 500 000 | | | |
| LANDESKREDITBANK BADEN-REG-S 1.37500% 22-27.01.25* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 519 | 0,01 |
| MCDONALD'S CORP 3.62500% 19-01.09.49* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 136 803 | 0,01 |
| MCDONALD'S CORP 3.80000% 18-01.04.28* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 130 256 | 0,01 |
| MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 21-02.09.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 164 581 | 0,01 |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 1.00000% 21-21.04.26* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 333 668 | 0,03 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4.60000% 14-15.05.44* | USD | 100 000 | 200 000 | | 300 000 | 243 211 | 0,02 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC 1.50000% 20-10.03.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 252 852 | 0,02 |
| PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.65000% 18-01.09.28* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 86 121 | 0,01 |
| ROYAL BANK OF CANADA 3.62500% 22-04.05.27* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 519 927 | 0,04 |
| RYDER SYSTEM INC 5.37500% 24-15.03.29* | USD | | 335 000 | | 335 000 | 304 239 | 0,03 |
| SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.01000% 16-19.10.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 171 047 | 0,01 |
| TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 1.00000% 20-06.10.30* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | |
| TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.59500% 18-19.01.28* | USD | 400 000 | | 400 000 | | | |
| TORONTO-DOMINION BANK/THE 2.80000% 22-10.03.27* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 424 026 | 0,04 |
| TRUIST FINANCIAL CORP 1.20000% 20-05.08.25* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 127 715 | 0,01 |
| TOTAL USD | | | | | | 10 150 287 | 0,84 |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 70 281 975 | 5,81 |

Medium-Term Notes, Nullcoupon

EUR

| | | | | | | | |
|---|-----|-----------|---------|---------|-----------|------------------|-------------|
| ACEA SPA -REG-S 0.00000% 21-28.09.25* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 183 639 | 0,02 |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.00000% 20-25.03.25* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 375 266 | 0,03 |
| APRR SA-REG-S 0.00000% 21-19.06.28* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 85 031 | 0,01 |
| BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 0.00000% 21-20.01.31* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 80 378 | 0,01 |
| CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 435 159 | 0,04 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 21-04.07.29* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 211 605 | 0,02 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 21-22.04.31* | EUR | 400 000 | 400 000 | | 800 000 | 645 798 | 0,05 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 21-04.10.28* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 861 603 | 0,07 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 14-15.12.27* | EUR | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 055 792 | 0,09 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 19-30.09.26* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 905 659 | 0,07 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 21-09.11.28* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 430 206 | 0,04 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 21-15.06.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 182 444 | 0,02 |
| LA POSTE-REG-S 0.00000% 21-18.07.29* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 81 818 | 0,01 |
| LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK-REG-S 0.00000% 19-27.11.29* | EUR | 600 000 | 200 000 | | 800 000 | 669 936 | 0,06 |
| LANXESS AG-REG-S 0.00000% 21-08.09.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 171 011 | 0,01 |
| LATVIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 0.00000% 21-17.03.31* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 230 958 | 0,02 |
| NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD-REG-S 0.00000% 20-03.03.33* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 75 193 | 0,01 |
| NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD-REG-S 0.00000% 21-14.06.26* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 272 581 | 0,02 |
| NORTH RHINE WESTPHALIA, STATE OF-REG-S 0.00000% 20-12.10.35* | EUR | | 300 000 | 300 000 | | | |
| RTE EDF TRANSPORT S A-REG-S 0.00000% 19-09.09.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 174 077 | 0,01 |
| TOTAL EUR | | | | | | 7 128 154 | 0,58 |
| Total Medium-Term Notes, Nullcoupon | | | | | | 7 128 154 | 0,58 |

Medium-Term Notes, variabler Zins

EUR

| | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|--|---------|---------|------|
| ASS GENERALI-REG-S-SUB 5.500%/3M EURIBOR+535BP 15-27.10.47* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 202 584 | 0,02 |
| AXA SA-REG-S SUB 3.875%/VAR 14-PRP* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 289 132 | 0,02 |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.625%/VAR 21-24.06.29* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 344 985 | 0,03 |
| BANK OF AMERICA CORP-REG-S 2.824%/VAR 22-27.04.33* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 784 | 0,01 |
| BK OF AMERICA CORP-REG-S 1.776%/3M EURIBOR+120BP 17-04.05.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 93 565 | 0,01 |
| BNP PARIBAS SA-REG-S 0.250%/VAR 21-13.04.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 271 828 | 0,02 |
| BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 0.875%/VAR 21-31.08.33* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 84 287 | 0,01 |
| BNP PARIBAS-REG-S 2.125%/VAR 19-23.01.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 188 985 | 0,02 |
| CAIXABANK SA-REG-S 0.750%/VAR 21-26.05.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 267 406 | 0,02 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| CITIGROUP INC-REG-S 0.500%/VAR 19-08.10.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 066 | 0,01 | |
| CNP ASSURANCES-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-30.06.51* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 171 928 | 0,01 | |
| DANSKE BANK A/S-REG-S 1.375%/VAR 22-17.02.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 185 835 | 0,02 | |
| DANSKE BANK A/S-REG-S-SUB 4.625%/VAR 24-14.05.34* | EUR | | 275 000 | | 275 000 | 268 960 | 0,02 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.375%/VAR 20-10.06.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 404 | 0,01 | |
| DNB BANK ASA-REG-S 1.625%/VAR 22-31.05.26* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 142 433 | 0,01 | |
| DNB BANK ASA-REG-S 3.625%/VAR 23-16.02.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 291 433 | 0,02 | |
| HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 4.856%/VAR 23-23.05.33* | EUR | | 250 000 | | 250 000 | 259 074 | 0,02 | |
| JP MORGAN CHASE & CO-REG-S 1.963%/VAR 22-23.03.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 750 | 0,01 | |
| MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FIN-REG-S 4.625%/VAR 22-07.02.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 201 580 | 0,02 | |
| MITSUBISHI UFJ FIN GROUP INC REG-S 2.264%/VAR 22-14.06.25* | EUR | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| SOCIETE GENERALE SA-SUB 1.000%/VAR 20-24.11.30* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 276 376 | 0,02 | |
| STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 3M BBSW+185BP 21-23.09.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 177 621 | 0,01 | |
| TOTAL SE-REG-S-SUB 1.625%/VAR 21-PRP* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 219 478 | 0,02 | |
| TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| UNICREDIT SPA-REG-S 1.250%/VAR 19-25.06.25* | EUR | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| TOTAL EUR | | | | | | 4 304 495 | 0,36 | |
| GBP | | | | | | | | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA 9.750%/RATING LINKED 09-30.07.24* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 230 439 | 0,02 | |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S 3.125%/VAR 22-06.10.26* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 219 400 | 0,02 | |
| BANK OF AMERICA CORP-REG-S 1.667%/VAR 21-02.06.29* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 199 936 | 0,02 | |
| BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 8.407%/VAR 22-14.11.32* | GBP | | 200 000 | | 200 000 | 242 013 | 0,02 | |
| BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-24.05.31* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 104 569 | 0,01 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE-REG-S 3.625%/VAR 22-29.10.29* | GBP | 150 000 | | | 150 000 | 161 271 | 0,01 | |
| HSBC BANK PLC 5.84400%/6M LIBOR+176BP 03-PRP* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 118 989 | 0,01 | |
| HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 2.256%/VAR 17-13.11.26* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 108 342 | 0,01 | |
| JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 1.895%/VAR 21-28.04.33* | GBP | 150 000 | | | 150 000 | 138 802 | 0,01 | |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC-REG-S-SUB 5.375%/VAR 15-27.10.45* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 226 140 | 0,02 | |
| M&G PLC-REG-S-SUB 5.000%/VAR 15-20.07.55* | GBP | 100 000 | 100 000 | | 200 000 | 210 399 | 0,02 | |
| NATWEST GROUP PLC-REG-S 3.619%/VAR 22-29.03.29* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 213 671 | 0,02 | |
| TOTAL GBP | | | | | | 2 173 972 | 0,18 | |
| USD | | | | | | | | |
| BANK OF AMERICA CORP 4.083%/VAR 20-20.03.51* | USD | 400 000 | 300 000 | | 700 000 | 517 018 | 0,04 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| MORGAN STANLEY 1.512%/VAR 21-20.07.27* | USD | 400 000 | 400 000 | | 800 000 | 661 331 | 0,05 | |
| STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 3.516%/VAR 19-12.02.30* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 349 823 | 0,03 | |
| TOTAL USD | | | | | | 1 528 173 | 0,13 | |
| Total Medium-Term Notes, variabler Zins | | | | | | 8 006 640 | 0,66 | |
| Anleihen, fester Zins | | | | | | | | |
| AUD | | | | | | | | |
| AUSTRALIA 1.25000% 20-21.05.32* | AUD | 800 000 | 800 000 | | 1 600 000 | 767 380 | 0,06 | |
| AUSTRALIA-REG-S 0.25000% 20-21.11.24* | AUD | 1 500 000 | | 700 000 | 800 000 | 458 637 | 0,04 | |
| AUSTRALIA-REG-S 0.25000% 20-21.11.25* | AUD | 1 000 000 | 1 000 000 | | 2 000 000 | 1 109 914 | 0,09 | |
| AUSTRALIA-REG-S 0.50000% 20-21.09.26* | AUD | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 707 824 | 0,06 | |
| AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30* | AUD | 800 000 | | | 800 000 | 392 909 | 0,03 | |
| AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.11.31* | AUD | 700 000 | | | 700 000 | 333 890 | 0,03 | |
| AUSTRALIA-REG-S 1.75000% 21-21.11.32* | AUD | 800 000 | | | 800 000 | 395 391 | 0,03 | |
| AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 16-21.11.27* | AUD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 570 699 | 0,05 | |
| AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 17-21.11.28* | AUD | 800 000 | | | 800 000 | 452 803 | 0,04 | |
| AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.11.29* | AUD | 800 000 | | | 800 000 | 447 755 | 0,04 | |
| AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 22-21.11.33* | AUD | 400 000 | 1 000 000 | | 1 400 000 | 759 220 | 0,06 | |
| AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47* | AUD | 850 000 | | | 850 000 | 401 627 | 0,03 | |
| AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 12-21.04.29* | AUD | 700 000 | | | 700 000 | 403 833 | 0,03 | |
| AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 13-21.04.25* | AUD | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | | |
| AUSTRALIA-REG-S 3.50000% 23-21.12.34* | AUD | | 700 000 | | 700 000 | 393 468 | 0,03 | |
| AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37* | AUD | 470 000 | | | 470 000 | 266 630 | 0,02 | |
| AUSTRALIA-REG-S 4.75000% 23-21.06.54* | AUD | | 500 000 | | 500 000 | 313 873 | 0,03 | |
| AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 4.50000% 23-23.10.34* | AUD | 100 000 | | | 100 000 | 58 277 | 0,00 | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 3.80000% 23-24.05.28* | AUD | | 500 000 | | 500 000 | 289 401 | 0,02 | |
| QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 3.50000% 17-21.08.30* | AUD | | 500 000 | | 500 000 | 283 322 | 0,02 | |
| QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 2.75000% 16-20.08.27* | AUD | 400 000 | | | 400 000 | 226 467 | 0,02 | |
| QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.75000% 19-21.08.31* | AUD | 300 000 | | | 300 000 | 148 217 | 0,01 | |
| QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 1.50000% 21-20.08.32* | AUD | 800 000 | | | 800 000 | 374 970 | 0,03 | |
| SOUTH AUSTRALIAN GOV FIN AUTHOR-REG-S 3.00000% 18-24.05.28* | AUD | 400 000 | | | 400 000 | 226 609 | 0,02 | |
| TREASURY CORP OF VICTORIA 2.00000% 21-17.09.35* | AUD | 300 000 | | | 300 000 | 131 784 | 0,01 | |
| TOTAL AUD | | | | | | 9 914 899 | 0,82 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------|--------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Anzahl/ Nominal | Verkäufe ² | | | |
| CAD | | | | | | | | |
| ALBERTA, PROVINCE OF 2.55000% | 17-01.06.27* | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 127 551 | 0,01 |
| ALBERTA, PROVINCE OF 3.05000% | 17-01.12.48* | CAD | 600 000 | | | 600 000 | 318 199 | 0,03 |
| CANADA HOUSING TRUST-144A 1.90000% | 16-15.09.26* | CAD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 632 093 | 0,05 |
| CANADA HOUSING TRUST 2.65000% | 18-15.12.28* | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 126 895 | 0,01 |
| CANADA HOUSING TRUST-144A 2.10000% | 19-15.09.29* | CAD | | 400 000 | | 400 000 | 244 918 | 0,02 |
| CANADA HOUSING TRUST-144A 1.80000% | 19-15.12.24* | CAD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 651 650 | 0,05 |
| CANADA HOUSING TRUST-144A 1.10000% | 20-15.03.31* | CAD | 250 000 | | | 250 000 | 139 633 | 0,01 |
| CANADA HOUSING TRUST NO 1-144A 2.15000% | 21-15.12.31* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 296 991 | 0,02 |
| CANADA HOUSING TRUST NO 1-144A 3.55000% | 22-15.09.32* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 195 983 | 0,02 |
| CANADA HOUSING TRUST NO 1-144A 4.25000% | 23-15.03.34* | CAD | | 500 000 | | 500 000 | 343 309 | 0,03 |
| CANADA, GOVERNMENT 0.50000% | 20-01.09.25* | CAD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 631 303 | 0,05 |
| CANADA, GOVERNMENT 0.50000% | 20-01.12.30* | CAD | 600 000 | | 600 000 | | | |
| CANADA, GOVERNMENT 0.25000% | 20-01.03.26* | CAD | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 743 103 | 0,06 |
| CANADA, GOVERNMENT 0.25000% | 21-01.08.23* | CAD | 500 000 | | 500 000 | | | |
| CANADA, GOVERNMENT 0.75000% | 21-01.02.24* | CAD | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | |
| CANADA, GOVERNMENT 1.25000% | 19-01.06.30* | CAD | 600 000 | 1 300 000 | 900 000 | 1 000 000 | 585 270 | 0,05 |
| CANADA, GOVERNMENT 1.25000% | 19-01.03.25* | CAD | 400 000 | | | 400 000 | 258 388 | 0,02 |
| CANADA, GOVERNMENT 1.75000% | 21-01.12.53* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 233 430 | 0,02 |
| CANADA, GOVERNMENT 1.25000% | 21-01.03.27* | CAD | | 1 300 000 | | 1 300 000 | 805 532 | 0,07 |
| CANADA, GOVERNMENT 1.50000% | 21-01.12.31* | CAD | 800 000 | | | 800 000 | 462 790 | 0,04 |
| CANADA, GOVERNMENT 1.50000% | 22-01.05.24* | CAD | 900 000 | | 900 000 | | | |
| CANADA, GOVERNMENT 2.75000% | 14-01.12.64* | CAD | | 300 000 | | 300 000 | 176 170 | 0,01 |
| CANADA, GOVERNMENT 2.75000% | 14-01.12.48* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 298 126 | 0,02 |
| CANADA, GOVERNMENT 2.00000% | 17-01.12.51* | CAD | 800 000 | | | 800 000 | 402 076 | 0,03 |
| CANADA, GOVERNMENT 2.25000% | 18-01.06.29* | CAD | 300 000 | 500 000 | | 800 000 | 503 580 | 0,04 |
| CANADA, GOVERNMENT 2.00000% | 22-01.06.32* | CAD | 700 000 | | | 700 000 | 417 933 | 0,03 |
| CANADA, GOVERNMENT 2.50000% | 22-01.12.32* | CAD | 600 000 | | | 600 000 | 370 943 | 0,03 |
| CANADA, GOVERNMENT 2.75000% | 23-01.06.33* | CAD | | 1 200 000 | 600 000 | 600 000 | 377 423 | 0,03 |
| CANADA, GOVERNMENT 3.75000% | 23-01.05.25* | CAD | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 320 077 | 0,11 |
| CANADA, GOVERNMENT 3.00000% | 23-01.06.34* | CAD | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 640 049 | 0,05 |
| CANADA, GOVERNMENT 4.00000% | 08-01.06.41* | CAD | 600 000 | | | 600 000 | 428 531 | 0,04 |
| CANADA, GOVERNMENT 5.00000% | 04-01.06.37* | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 154 667 | 0,01 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.00000% | 21-01.09.26* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 310 691 | 0,03 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.50000% | 21-01.06.31* | CAD | | 1 100 000 | | 1 100 000 | 642 488 | 0,05 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75000% | 22-01.09.27* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 323 207 | 0,03 |
| CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75000% | 22-01.08.24* | CAD | 1 200 000 | | 1 200 000 | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.90000% | 20-22.01.25* | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 130 025 | 0,01 |
| MANITOBA, PROVINCE OF 4.10000% | 10-05.03.41* | CAD | 100 000 | | | 100 000 | 63 551 | 0,01 |
| NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 4.80000% | 10-03.06.41* | CAD | 100 000 | | | 100 000 | 69 328 | 0,01 |
| ONTARIO, PROVINCE OF 3.45000% | 12-02.06.45* | CAD | 1 100 000 | | | 1 100 000 | 640 299 | 0,05 |
| ONTARIO, PROVINCE OF 2.90000% | 15-02.12.46* | CAD | 100 000 | | | 100 000 | 52 621 | 0,00 |
| ONTARIO, PROVINCE OF 2.40000% | 15-02.06.26* | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 128 186 | 0,01 |
| QUEBEC, PROVINCE OF 5.00000% | 09-01.12.41* | CAD | 600 000 | | | 600 000 | 430 511 | 0,04 |
| QUEBEC, PROVINCE OF 3.00000% | 12-01.09.23* | CAD | 200 000 | | 200 000 | | | |
| QUEBEC, PROVINCE OF 3.50000% | 15-01.12.48* | CAD | 200 000 | 400 000 | | 600 000 | 347 541 | 0,03 |
| QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% | 16-01.09.26* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 192 254 | 0,02 |
| SASKATCHEWAN, PROVINCE OF 3.30000% | 16-02.06.48* | CAD | 400 000 | | | 400 000 | 222 640 | 0,02 |
| TOTAL CAD | | | | | | | 15 439 956 | 1,28 |
| CZK | | | | | | | | |
| CZECH REPUBLIC 0.05000% | 20-29.11.29* | CZK | 20 000 000 | | | 20 000 000 | 625 316 | 0,05 |
| CZECH REPUBLIC 1.75000% | 21-23.06.32* | CZK | 16 000 000 | | | 16 000 000 | 522 741 | 0,04 |
| CZECH REPUBLIC-REG-S 1.00000% | 15-26.06.26* | CZK | 5 000 000 | | | 5 000 000 | 180 774 | 0,01 |
| TOTAL CZK | | | | | | | 1 328 830 | 0,11 |
| DKK | | | | | | | | |
| DENMARK, KINGDOM OF 4.50000% | 08-15.11.39* | DKK | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 327 718 | 0,03 |
| DENMARK, KINGDOM OF 1.75000% | 13-15.11.25* | DKK | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 192 129 | 0,02 |
| DENMARK, KINGDOM OF 0.50000% | 17-15.11.27* | DKK | 4 000 000 | | | 4 000 000 | 487 266 | 0,04 |
| NYKREDIT REALKREDIT AS-REG-S 1.00000% | 20-01.07.26* | DKK | 4 000 000 | | | 4 000 000 | 498 175 | 0,04 |
| REALKREDIT DANMARK A/S-REG-S 1.00000% | 14-01.01.26* | DKK | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 251 495 | 0,02 |
| TOTAL DKK | | | | | | | 1 756 783 | 0,15 |
| EUR | | | | | | | | |
| ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.12500% | 19-23.04.39* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 146 720 | 0,01 |
| AEROPORTS DE PARIS-REG-S 1.50000% | 14-07.04.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 95 223 | 0,01 |
| ALD SA-REG-S 4.87500% | 23-06.10.28* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 203 576 | 0,02 |
| ALTRIA GROUP INC 3.12500% | 19-15.06.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 181 561 | 0,02 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 1.875000% 17-21.06.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 138 | 0,01 |
| APPLE INC 1.625000% 14-10.11.26* | EUR | 100 000 | 300 000 | | 400 000 | 374 604 | 0,03 |
| ARKEA HOME LOANS SFH-REG-S 0.750000% 17-05.10.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 89 860 | 0,01 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.500000% 19-20.02.29* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 526 472 | 0,04 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.750000% 20-20.03.51* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 230 296 | 0,02 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.700000% 21-20.04.71* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 90 311 | 0,01 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.250000% 21-20.10.36* | EUR | | 600 000 | | 600 000 | 421 223 | 0,03 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.900000% 22-20.02.32* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 592 361 | 0,05 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.850000% 22-23.05.49* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 154 594 | 0,01 |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.000000% 22-15.07.26* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 572 663 | 0,05 |
| AUTOBAHNEN- & SCHNELLSTRASSENFINA-REG-S 0.100000% 19-09.07.29* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 84 782 | 0,01 |
| BANCO DE SABADELL SA-REG-S 1.000000% 17-26.04.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 920 | 0,01 |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.000000% 15-07.04.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 715 | 0,01 |
| BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.125000% 18-25.10.28* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 356 437 | 0,03 |
| BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.010000% 20-14.01.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 88 980 | 0,01 |
| BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 0.375000% 22-26.03.30* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 248 859 | 0,02 |
| BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WI-REG-S 1.125000% 22-31.07.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 268 594 | 0,02 |
| BELFIUS BANK SA-REG-S 0.375000% 20-02.09.25* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 185 671 | 0,02 |
| BELGIUM, KINGDOM OF 5.500000% 97-28.03.28* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 538 406 | 0,04 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 4.250000% 10-28.03.41* | EUR | 200 000 | 200 000 | | 400 000 | 443 888 | 0,04 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 3.750000% 13-22.06.45* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 627 881 | 0,05 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.800000% 15-22.06.25* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 188 831 | 0,02 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.000000% 16-22.06.26* | EUR | 450 000 | | | 450 000 | 420 563 | 0,03 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.150000% 16-22.06.66* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 148 598 | 0,01 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.450000% 17-22.06.37* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 121 125 | 0,01 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.900000% 19-22.06.29* | EUR | 800 000 | | 800 000 | | | |
| BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 0.100000% 20-22.06.30* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 499 415 | 0,04 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.350000% 22-22.06.32* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 642 223 | 0,05 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.400000% 22-22.06.53* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 251 883 | 0,02 |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.750000% 22-22.04.39* | EUR | | 500 000 | 500 000 | | | |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.300000% 23-22.06.54* | EUR | | 500 000 | | 500 000 | 482 127 | 0,04 |
| BERLIN HYP AG-REG-S 0.750000% 18-26.02.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 92 848 | 0,01 |
| BERLIN HYP AG-REG-S 3.375000% 23-23.08.28* | EUR | | 100 000 | | 100 000 | 98 989 | 0,01 |
| BPCE SA-REG-S 0.250000% 21-14.01.31* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 236 485 | 0,02 |
| BPCE SFH SA-REG-S 0.010000% 20-23.03.28* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 345 534 | 0,03 |
| BPCE SOCIETE DE FINANCEMENT DE-REG-S 0.010000% 20-10.11.27* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 349 191 | 0,03 |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUND-REG-S 1.700000% 22-15.08.32* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 653 202 | 0,05 |
| CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.375000% 14-25.11.24* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 95 746 | 0,01 |
| CAISSE DE REFIEMT DE L'HAAT SA-REG-S 2.750000% 22-12.04.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 288 919 | 0,02 |
| CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATION-REG-S 3.000000% 23-25.05.28* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 292 716 | 0,02 |
| CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT REG-S 0.010000% 21-01.10.29* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 662 836 | 0,05 |
| CAIXABANK SA-REG-S 1.000000% 15-25.09.25* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 187 314 | 0,02 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM-REG-S 0.010000% 21-30.04.29* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 249 989 | 0,02 |
| CK HUTCHISON EUROPE FIN 18 LTD-REG-S 1.250000% 18-13.04.25* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 188 984 | 0,02 |
| COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER-REG-S 0.225000% 16-14.09.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 554 | 0,01 |
| COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER-REG-S 0.010000% 19-10.11.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 261 605 | 0,02 |
| COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BK-REG-S 0.750000% 18-24.01.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 270 970 | 0,02 |
| CREDIT AGRICOLE HOME LOAN-REG-S 3.125000% 23-18.10.30* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 393 132 | 0,03 |
| CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA-REG-S 0.250000% 20-17.01.28* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 173 733 | 0,01 |
| CREDIT MUTUEL HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.750000% 17-15.09.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 011 | 0,01 |
| DANSKE KIINNYSLUOTTOPANKKI OYJ-REG-S 0.010000% 20-14.01.28* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 86 595 | 0,01 |
| DH EUROPE FINANCE II SARL 0.200000% 19-18.03.26* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 228 323 | 0,02 |
| ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.250000% 20-19.10.30* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 322 939 | 0,03 |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.700000% 20-20.01.50* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 57 220 | 0,00 |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 0.375000% 16-14.04.26* | EUR | 300 000 | | 300 000 | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.200000% 21-17.03.36* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 142 213 | 0,01 |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 0.375000% 22-15.09.27* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 448 475 | 0,04 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 0.400000% 21-04.02.37* | EUR | 900 000 | | | 900 000 | 642 296 | 0,05 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 1.000000% 22-06.07.32* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 594 024 | 0,05 |
| EUROPEAN UNION-REG-S 0.700000% 21-06.07.51* | EUR | 800 000 | 200 000 | | 1 000 000 | 539 024 | 0,04 |
| FEDEX CORP 0.450000% 21-04.05.29* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 210 374 | 0,02 |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.625000% 12-04.07.42* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 277 070 | 0,02 |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.750000% 15-15.04.31* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 256 212 | 0,02 |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.500000% 17-15.09.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 270 491 | 0,02 |
| FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.875000% 23-15.04.29* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 294 723 | 0,02 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.750000% 01-25.10.32* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 595 560 | 0,05 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.000000% 05-25.04.55* | EUR | 350 000 | | | 350 000 | 387 347 | 0,03 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.500000% 09-25.04.41* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 921 276 | 0,08 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.000000% 10-25.04.60* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 224 789 | 0,02 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.250000% 12-25.05.45* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 491 284 | 0,04 |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.500000% 13-25.05.30* | EUR | | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 545 007 | 0,13 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-----------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 14-25.11.24* | EUR | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.50000% 15-25.05.25* | EUR | 1 600 000 | | | 1 600 000 | 1 507 718 | 0,12 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.00000% 15-25.11.25* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 941 161 | 0,08 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.50000% 15-25.05.31* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 900 885 | 0,07 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 16-25.05.26* | EUR | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 313 608 | 0,19 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 15-25.05.66* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 166 074 | 0,01 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.25000% 15-25.05.36* | EUR | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 967 872 | 0,08 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.25000% 15-25.11.26* | EUR | | 2 300 000 | | 2 300 000 | 2 094 717 | 0,17 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 17-25.06.39* | EUR | 900 000 | | | 900 000 | 740 215 | 0,06 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.00000% 17-25.05.27* | EUR | 900 000 | | 900 000 | | | | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 2.00000% 17-25.05.48* | EUR | | 700 000 | | 700 000 | 543 842 | 0,04 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.25000% 18-25.05.34* | EUR | 900 000 | | | 900 000 | 755 170 | 0,06 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.75000% 18-25.11.28* | EUR | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 072 162 | 0,09 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 475 956 | 0,04 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.50000% 19-25.05.29* | EUR | 900 000 | | | 900 000 | 786 836 | 0,07 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.75000% 20-25.05.52* | EUR | 850 000 | | | 850 000 | 454 247 | 0,04 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 20-25.05.40* | EUR | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 852 005 | 0,07 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.75000% 21-25.05.53* | EUR | 400 000 | 600 000 | 500 000 | 500 000 | 261 230 | 0,02 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.25000% 22-25.05.38* | EUR | | 900 000 | | 900 000 | 696 357 | 0,06 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.75000% 22-25.02.28* | EUR | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 1 085 253 | 0,09 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 2.00000% 22-25.11.32* | EUR | 900 000 | | | 900 000 | 826 480 | 0,07 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.00000% 22-25.05.33* | EUR | | 500 000 | | 500 000 | 495 473 | 0,04 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.50000% 23-25.11.33* | EUR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 029 135 | 0,09 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 3.25000% 24-25.05.55* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 288 237 | 0,02 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 21-25.06.44* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT-144A-REG-S 0.50000% 21-25.05.72* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 38 426 | 0,00 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 14-15.02.24* | EUR | 1 700 000 | | 1 700 000 | | | | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.50000% 14-15.08.46* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 488 421 | 0,04 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 15-15.02.25* | EUR | 700 000 | | 700 000 | | | | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 15-15.08.25* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 945 713 | 0,08 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 16-15.02.26* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 932 095 | 0,08 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 17-15.08.27* | EUR | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 824 882 | 0,15 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.25000% 17-15.08.48* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 532 269 | 0,04 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.50000% 18-15.02.28* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 453 063 | 0,04 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 18-15.08.28* | EUR | | 1 100 000 | | 1 100 000 | 979 109 | 0,08 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 22-15.05.38* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 322 644 | 0,03 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.80000% 22-15.08.53* | EUR | | 500 000 | | 500 000 | 420 857 | 0,03 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.20000% 22-14.06.24* | EUR | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 03-04.07.34* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 593 176 | 0,05 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 4.00000% 05-04.01.37* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 570 682 | 0,05 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 4.25000% 07-04.07.39* | EUR | 650 000 | | | 650 000 | 774 779 | 0,06 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 3.25000% 10-04.07.42* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 540 658 | 0,04 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.50000% 12-04.07.44* | EUR | 150 000 | 900 000 | | 1 050 000 | 1 023 302 | 0,08 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.40000% 23-15.11.30* | EUR | | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 372 609 | 0,11 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.50000% 24-15.08.54* | EUR | | 400 000 | | 400 000 | 392 705 | 0,03 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.30000% 23-15.02.33* | EUR | | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 366 666 | 0,11 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.60000% 23-15.08.33* | EUR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 999 098 | 0,08 | |
| HAMBURG, FREIE HANSESTADT-REG-S 0.25000% 17-20.01.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 751 | 0,01 | |
| HESSEN, STATE OF-REG-S 0.37500% 16-06.07.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 745 | 0,01 | |
| HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S 0.50000% 20-23.04.31* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 157 363 | 0,01 | |
| ING BANK NV-REG-S 2.75000% 24-10.01.32* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 289 300 | 0,02 | |
| INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 1.12500% 17-16.06.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 272 956 | 0,02 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.70000% 21-22.10.46* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 122 003 | 0,01 | |
| INVESTITIONSBANK BERLIN-REG-S 3.12500% 23-01.03.33* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 199 989 | 0,02 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.00000% 23-18.10.43* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 196 088 | 0,02 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF 5.40000% 09-13.03.25* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 395 756 | 0,03 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.10000% 19-15.05.29* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 271 486 | 0,02 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 19-15.05.50* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 70 836 | 0,01 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.20000% 20-18.10.30* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 334 006 | 0,03 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.35000% 22-18.10.32* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 402 536 | 0,03 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 234 071 | 0,02 | |
| IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.70000% 17-15.05.37* | EUR | 550 000 | | | 550 000 | 467 603 | 0,04 | |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL-144A-REG-S 0.95000% 21-01.03.37* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 554 160 | 0,05 | |
| ITALY, REPUBLIC OF BTP-REG-S 2.80000% 18-01.12.28* | EUR | 1 900 000 | | 900 000 | 1 000 000 | 958 686 | 0,08 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 3.35000% 19-01.03.35* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 282 570 | 0,02 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 3.85000% 19-01.09.49* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 467 861 | 0,04 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.85000% 20-01.07.25* | EUR | 900 000 | 600 000 | | 1 500 000 | 1 431 848 | 0,12 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.80000% 20-01.03.41* | EUR | 900 000 | | | 900 000 | 641 543 | 0,05 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.70000% 20-01.09.51* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 363 961 | 0,03 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.15000% 21-01.03.72* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 152 683 | 0,01 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP 5.00000% 07-01.08.39* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 434 888 | 0,04 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.75000% 13-01.09.44* | EUR | 550 000 | | | 550 000 | 584 276 | 0,05 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.50000% 14-01.03.30* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 986 087 | 0,08 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.65000% 15-01.03.32* | EUR | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 111 366 | 0,09 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.70000% 16-01.03.47* | EUR | 550 000 | | | 550 000 | 428 756 | 0,04 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.45000% 17-01.09.33* | EUR | | 800 000 | | 800 000 | 710 702 | 0,06 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.95000% 18-01.09.38* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 261 465 | 0,02 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 2.50000% 18-15.11.25* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 961 180 | 0,08 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 3.00000% 19-01.08.29* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 963 626 | 0,08 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.10000% 19-01.03.40* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 436 806 | 0,04 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 2.65000% 19-01.02.25* | EUR | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 421 144 | 0,12 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.45000% 20-01.03.36* | EUR | | 1 100 000 | | 1 100 000 | 834 616 | 0,07 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 0.95000% 20-15.09.27* | EUR | 600 000 | 500 000 | 1 100 000 | | | |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 0.25000% 21-15.03.28* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 869 910 | 0,07 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 2.50000% 21-15.07.28* | EUR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 871 562 | 0,07 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 0.95000% 21-01.12.31* | EUR | | 1 300 000 | | 1 300 000 | 1 058 203 | 0,09 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.15000% 22-01.09.52* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 198 710 | 0,02 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 1.10000% 22-01.04.27* | EUR | 700 000 | 1 000 000 | | 1 700 000 | 1 558 913 | 0,13 |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 2.65000% 22-01.12.27* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 574 490 | 0,05 |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 0.85000% 19-15.01.27* | EUR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 914 352 | 0,08 |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 0.90000% 20-01.04.31* | EUR | 800 000 | | 800 000 | | | |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S-144A 0.60000% 21-01.08.31* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 799 504 | 0,07 |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 2.50000% 22-01.12.32* | EUR | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 082 565 | 0,09 |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 4.40000% 22-01.05.33* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 037 697 | 0,09 |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 4.20000% 23-01.03.34* | EUR | | 1 500 000 | | 1 500 000 | 1 527 713 | 0,13 |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 4.00000% 23-15.11.30* | EUR | 700 000 | 700 000 | | 700 000 | 707 066 | 0,06 |
| KBC BANK NV-REG-S 3.25000% 23-30.05.28* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 294 512 | 0,02 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.37500% 16-09.03.26* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 185 054 | 0,02 |
| LAND BERLIN-REG-S 1.37500% 18-27.08.38* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 79 653 | 0,01 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC 0.25000% 21-17.03.28* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 173 129 | 0,01 |
| MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.62500% 18-10.11.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 179 162 | 0,01 |
| NATIONALENEDERLANDEN BANK-REG-S 0.37500% 21-04.03.41* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 62 123 | 0,01 |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK-REG-S 0.12500% 20-03.09.35* | EUR | 250 000 | | 250 000 | | | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK NV-REG-S 3.00000% 23-20.04.33* | EUR | | 200 000 | | 200 000 | 197 631 | 0,02 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 4.00000% 05-15.01.37* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 556 387 | 0,05 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 3.75000% 10-15.01.42* | EUR | 460 000 | | | 460 000 | 513 681 | 0,04 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 2.75000% 14-15.01.47* | EUR | 400 000 | | 100 000 | 300 000 | 296 321 | 0,02 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.75000% 17-15.07.27* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 367 058 | 0,03 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.75000% 18-15.07.28* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 723 195 | 0,06 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.50000% 22-15.07.32* | EUR | 400 000 | | 400 000 | | | |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 2.00000% 22-15.01.54* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 168 715 | 0,01 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 2.50000% 23-15.07.33* | EUR | 700 000 | 1 300 000 | 1 400 000 | 600 000 | 580 932 | 0,05 |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 3.25000% 23-15.01.44* | EUR | | 500 000 | | 500 000 | 527 250 | 0,04 |
| NORDDDEUTSCHE LANDESBANK-GIROZENTR-REG-S 0.50000% 18-29.06.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 91 638 | 0,01 |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 1.00000% 16-16.10.46* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 64 873 | 0,01 |
| NOVARTIS FINANCE SA-REG-S 1.62500% 14-09.11.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 93 959 | 0,01 |
| NOVARTIS FINANCE SA-REG-S 1.70000% 18-14.08.38* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 164 617 | 0,01 |
| NRW BANK 0.12500% 18-07.07.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| NRW BANK 0.12500% 22-04.02.30* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 250 974 | 0,02 |
| NRW BANK-REG-S 0.50000% 17-13.09.27* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 89 772 | 0,01 |
| OP MORTGAGE BANK-REG-S 0.62500% 18-01.09.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 93 579 | 0,01 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.10000% 15-15.02.45* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 267 732 | 0,02 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.87500% 15-15.10.25* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 484 938 | 0,04 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.47500% 20-18.10.30* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 254 330 | 0,02 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-OT-144A-REG-S 0.90000% 20-12.10.35* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 154 219 | 0,01 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.12500% 17-14.04.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 304 644 | 0,03 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.12500% 18-17.10.28* | EUR | 650 000 | | | 650 000 | 621 587 | 0,05 |
| PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.65000% 22-16.07.32* | EUR | 200 000 | 600 000 | | 800 000 | 712 963 | 0,06 |
| PPG INDUSTRIES INC 2.75000% 22-01.06.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 188 259 | 0,02 |
| PROGRAMA CEDULAS TDA 1 4.25000% 06-10.04.31* | EUR | | 300 000 | | 300 000 | 313 512 | 0,03 |
| PROLOGIS EURO FINANCE LLC 1.87500% 18-05.01.29* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 271 168 | 0,02 |
| QUEBEC, PROVINCE OF-REG-S 0.87500% 17-04.05.27* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 364 568 | 0,03 |
| RELX FINANCE BV-REG-S 1.50000% 18-13.05.27* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 277 688 | 0,02 |
| RHEINLAND-PFALZ, STATE OF-REG-S 0.50000% 15-21.01.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 928 | 0,01 |
| RHEINLAND-PFALZ, STATE OF-REG-S 0.01000% 21-21.01.31* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 243 821 | 0,02 |
| RICHEMONT INTERNATIONAL HOLDING SA-REG-S 1.50000% 18-26.03.30* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 178 016 | 0,01 |
| SACHSEN-ANHALT, STATE OF-REG-S 0.01000% 21-09.11.26* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 90 198 | 0,01 |
| SAP SE-REG-S 0.37500% 20-18.05.29* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 171 010 | 0,01 |
| SCHLESWIG-HOLSTEIN, STATE OF-REG-S 0.62500% 18-31.08.28* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 266 142 | 0,02 |
| SKY PLC-REG-S 2.25000% 15-17.11.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 95 407 | 0,01 |
| SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 20-14.05.32* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 325 795 | 0,03 |
| SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.75000% 19-09.04.30* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 506 528 | 0,04 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | |
| SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 82 982 | 0,01 |
| SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.25000% 17-22.03.27* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 464 501 | 0,04 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND-144A-REG-S 0.25000% 19-30.07.24* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 5.15000% 13-31.10.44* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 238 002 | 0,02 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.80000% 14-30.04.24* | EUR | 1 600 000 | | 1 600 000 | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 15-30.07.30* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 737 511 | 0,06 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 16-30.04.26* | EUR | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 237 647 | 0,10 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 433 280 | 0,04 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.45000% 16-30.07.66* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 180 882 | 0,01 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.30000% 16-31.10.26* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 653 738 | 0,05 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.70000% 18-31.10.48* | EUR | | 700 000 | | 700 000 | 577 115 | 0,05 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.40000% 18-30.07.28* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 734 174 | 0,06 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.45000% 19-30.04.29* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 910 883 | 0,08 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.85000% 19-30.07.35* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 677 505 | 0,06 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 20-31.10.50* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 215 913 | 0,02 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.25000% 20-31.10.30* | EUR | | 600 000 | | 600 000 | 526 870 | 0,04 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.20000% 20-31.10.40* | EUR | 1 100 000 | | | 1 100 000 | 759 894 | 0,06 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.85000% 21-30.07.37* | EUR | 300 000 | 700 000 | | 1 000 000 | 711 085 | 0,06 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 21-30.07.42* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 321 885 | 0,03 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.70000% 22-30.04.32* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 815 170 | 0,07 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 22-31.10.52* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 199 806 | 0,02 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.15000% 23-30.04.33* | EUR | 600 000 | 600 000 | | 1 200 000 | 1 175 124 | 0,10 |
| SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.55000% 23-31.10.33* | EUR | | 900 000 | | 900 000 | 907 013 | 0,08 |
| SPAIN, KINGDOM OF-REG-S-144A 1.45000% 21-31.10.71* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 73 209 | 0,01 |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-REG-S 3.00000% 18-21.11.30* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 845 | 0,01 |
| UNEDIC ASSEO-REG-S 0.62500% 15-17.02.25* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 94 692 | 0,01 |
| UNICREDIT BANK GMBH-REG-S 0.25000% 20-15.01.32* | EUR | 100 000 | | | 100 000 | 79 614 | 0,01 |
| VF CORP 0.62500% 16-20.09.23* | EUR | 100 000 | | 100 000 | | | |
| WALMART INC 4.87500% 09-21.09.29* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 266 531 | 0,02 |
| TOTAL EUR | | | | | | 110 840 224 | 9,17 |

GBP

| | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------|
| COMCAST CORP 5.50000% 10-23.11.29* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 238 039 | 0,02 |
| LCR FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 99-07.12.28* | GBP | 150 000 | | | 150 000 | 172 845 | 0,01 |
| NATIONAL GRID ELEC DISTRI PLC-REG-S 3.50000% 18-16.10.26* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 109 161 | 0,01 |
| NOTTING HILL GENESIS-REG-S 5.25000% 10-07.07.42* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 111 955 | 0,01 |
| PEABODY CAPITAL NO 2 PLC-REG-S 2.75000% 22-02.03.34* | GBP | | 100 000 | | 100 000 | 93 114 | 0,01 |
| SOUTHERN ELECTRIC POWER DISTRIB-REG-S 5.50000% 01-07.06.32* | GBP | | 150 000 | | 150 000 | 179 053 | 0,01 |
| UK TREASURY GILT STRIP-REG-S 4.12500% 22-29.01.27* | GBP | | 700 000 | | 700 000 | 796 825 | 0,07 |
| UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 1.25000% 20-22.10.41* | GBP | 700 000 | | | 700 000 | 499 623 | 0,04 |
| UNITED KINGDOM OF GRET BRT & N IRL-REG-S 3.75000% 22-29.01.38* | GBP | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 087 800 | 0,09 |
| UNITED KINGDOM GILT-REG-S 4.50000% 09-07.09.34* | GBP | 800 000 | | | 800 000 | 952 142 | 0,08 |
| UNITED KINGDOM GILT-REG-S 1.62500% 18-22.10.28* | GBP | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 1 036 772 | 0,09 |
| UNITED KINGDOM GILT-REG-S 0.25000% 21-31.01.25* | GBP | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | |
| UNITED KINGDOM GILT-REG-S 0.25000% 20-31.07.31* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 176 497 | 0,01 |
| UNITED KINGDOM GREAT BRITAIN IRL-REG-S 4.25000% 00-07.06.32* | GBP | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| UNITED KINGDOM OF GB & N IRL-REG-S 1.62500% 18-22.10.71* | GBP | 450 000 | | | 450 000 | 245 152 | 0,02 |
| UNITED KINGDOM OF GB AND NRTH IRL-REG-S 0.50000% 21-31.01.29* | GBP | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 458 949 | 0,12 |
| UNITED KINGDOM OF GB AND NRTH IRL-REG-S 0.62500% 20-22.10.50* | GBP | 500 000 | | | 500 000 | 237 353 | 0,02 |
| UNITED KINGDOM OF GB & N IRL-REG-S 3.25000% 23-31.01.33* | GBP | | 600 000 | | 600 000 | 651 288 | 0,05 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 4.25000% 05-07.12.55* | GBP | 400 000 | | | 400 000 | 443 837 | 0,04 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 4.25000% 08-07.12.49* | GBP | 150 000 | 400 000 | | 550 000 | 610 882 | 0,05 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 4.00000% 09-22.01.60* | GBP | 400 000 | | | 400 000 | 426 421 | 0,04 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 4.25000% 10-07.12.40* | GBP | 600 000 | | | 600 000 | 679 793 | 0,06 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 3.75000% 11-22.07.52* | GBP | 530 000 | | | 530 000 | 540 544 | 0,04 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 3.25000% 12-22.01.44* | GBP | 600 000 | | | 600 000 | 580 829 | 0,05 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 3.50000% 13-22.07.68* | GBP | 330 000 | | | 330 000 | 317 960 | 0,03 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.75000% 17-22.07.57* | GBP | 400 000 | 350 000 | | 750 000 | 468 751 | 0,04 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.47* | GBP | 250 000 | | | 250 000 | 165 305 | 0,01 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.25000% 17-22.07.27* | GBP | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 1 044 714 | 0,09 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.75000% 18-22.01.49* | GBP | 560 000 | | | 560 000 | 385 235 | 0,03 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 2.75000% 14-07.09.24* | GBP | 700 000 | | 700 000 | | | |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.62500% 19-22.10.54* | GBP | 500 000 | | | 500 000 | 308 005 | 0,03 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.87500% 19-22.10.29* | GBP | | 600 000 | | 600 000 | 584 857 | 0,05 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.62500% 19-07.06.25* | GBP | 1 600 000 | | 800 000 | 800 000 | 870 398 | 0,07 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.37500% 20-22.10.30* | GBP | 900 000 | | | 900 000 | 824 854 | 0,07 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.12500% 20-30.01.26* | GBP | 1 400 000 | | | 1 400 000 | 1 481 396 | 0,12 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.25000% 21-31.07.51* | GBP | 1 000 000 | 350 000 | 1 000 000 | 350 000 | 201 227 | 0,02 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.00000% 21-31.01.32* | GBP | 800 000 | | | 800 000 | 738 018 | 0,06 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 21-31.07.53* | GBP | 50 000 | 500 000 | | 550 000 | 330 342 | 0,03 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.50000% 20-22.10.61* | GBP | 500 000 | | | 500 000 | 176 637 | 0,01 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| UNITED KINGDOM OF GRT BRTN&N IRL-REG-S 0.125000% 20-31.01.28* | GBP | 700 000 | | | 700 000 | 691 506 | 0,06 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 4.500000% 23-07.06.28* | GBP | | 1 520 000 | | 1 520 000 | 1 767 605 | 0,15 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.125000% 20-31.01.24* | GBP | 1 350 000 | | 1 350 000 | | | |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN&N-REG-S 3.500000% 14-22.01.45* | GBP | 600 000 | | | 600 000 | 599 902 | 0,05 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.875000% 21-31.01.46* | GBP | 600 000 | | | 600 000 | 349 398 | 0,03 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 4.625000% 15-31.01.34* | GBP | | 920 000 | | 920 000 | 1 105 806 | 0,09 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 2.500000% 15-22.07.65* | GBP | 350 000 | | | 350 000 | 261 521 | 0,02 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.500000% 16-22.07.26* | GBP | | 900 000 | | 900 000 | 967 136 | 0,08 |
| UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.750000% 16-07.09.37* | GBP | 700 000 | | | 700 000 | 603 005 | 0,05 |
| UNITED KINGDOM TREASURY GILT 4.250000% 09-07.09.39* | GBP | 650 000 | | | 650 000 | 740 615 | 0,06 |
| UNITED KINGDOM TREASURY GILT-REG-S 1.125000% 21-31.01.39* | GBP | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 752 108 | 0,06 |
| UNITED KINGDOM TREASURY GILT-REG-S 4.000000% 23-22.10.63* | GBP | | 440 000 | 200 000 | 240 000 | 255 106 | 0,02 |
| UNITED KINGDOM TREASURY GILT STRIP-REG-S 0.375000% 21-22.10.26* | GBP | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 244 358 | 0,10 |
| UNITEDKINGDOM GREAT BRITAIN IRL-REG-S 4.250000% 03-07.03.36* | GBP | 500 000 | | | 500 000 | 580 813 | 0,05 |
| UNITEDKINGDOM GREAT BRITAIN IRL-REG-S 4.750000% 04-07.12.38* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 241 428 | 0,02 |
| UNITEDKINGDOM GREAT BRITAIN IRL-REG-S 4.250000% 06-07.12.46* | GBP | 300 000 | | | 300 000 | 334 038 | 0,03 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.125000% 16-02.11.35* | GBP | 200 000 | | | 200 000 | 188 080 | 0,02 |
| WELLCOME TRUST LTD/THE-REG-S 2.517000% 18-07.02.2118* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 62 286 | 0,01 |
| WELLTOWER OP LLC 4.800000% 13-20.11.28* | GBP | 100 000 | | | 100 000 | 112 414 | 0,01 |
| TOTAL GBP | | | | | | 30 083 698 | 2,49 |
| HUF | | | | | | | |
| HUNGARY GOVERNMENT BOND 1.000000% 19-26.11.25* | HUF | 250 000 000 | | | 250 000 000 | 564 668 | 0,05 |
| HUNGARY, REPUBLIC OF 3.000000% 19-21.08.30* | HUF | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 200 631 | 0,02 |
| TOTAL HUF | | | | | | 765 299 | 0,06 |
| IDR | | | | | | | |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 7.000000% 19-15.09.30* | IDR | 7 000 000 000 | | | 7 000 000 000 | 405 710 | 0,03 |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 5.500000% 20-15.04.26* | IDR | 30 000 000 000 | | | 30 000 000 000 | 1 674 433 | 0,14 |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 7.125000% 21-15.06.42* | IDR | 15 000 000 000 | | | 15 000 000 000 | 867 808 | 0,07 |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 7.000000% 22-15.02.33* | IDR | 20 000 000 000 | | | 20 000 000 000 | 1 161 339 | 0,10 |
| INDONESIA, REPUBLIC OF 7.125000% 22-15.06.38* | IDR | 10 000 000 000 | | | 10 000 000 000 | 580 126 | 0,05 |
| TOTAL IDR | | | | | | 4 689 416 | 0,39 |
| ILS | | | | | | | |
| ISRAEL GOVERNMENT BOND 1.500000% 20-31.05.37* | ILS | 400 000 | 1 500 000 | | 1 900 000 | 324 284 | 0,03 |
| ISRAEL, STATE OF 0.500000% 21-27.02.26* | ILS | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 229 971 | 0,02 |
| ISRAEL, STATE OF 1.000000% 19-31.03.30* | ILS | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 614 771 | 0,05 |
| ISRAEL, STATE OF 2.000000% 16-31.03.27* | ILS | 500 000 | | | 500 000 | 115 950 | 0,01 |
| TOTAL ILS | | | | | | 1 284 975 | 0,11 |
| JPY | | | | | | | |
| JAPAN 0.005000% 21-20.06.26* | JPY | 130 000 000 | 70 000 000 | | 200 000 000 | 1 185 369 | 0,10 |
| JAPAN 0.005000% 22-01.04.24* | JPY | 300 000 000 | | 300 000 000 | | | |
| JAPAN 0.005000% 22-20.12.26* | JPY | | 200 000 000 | | 200 000 000 | 1 184 131 | 0,10 |
| JAPAN 0.005000% 22-20.03.27* | JPY | 300 000 000 | | 300 000 000 | | | |
| JAPAN 0.005000% 23-01.10.25* | JPY | | 300 000 000 | | 300 000 000 | 1 782 624 | 0,15 |
| JAPAN 0.100000% 16-20.03.26* | JPY | 80 000 000 | 200 000 000 | | 280 000 000 | 1 663 649 | 0,14 |
| JAPAN 0.100000% 16-20.06.26* | JPY | 280 000 000 | | | 280 000 000 | 1 663 049 | 0,14 |
| JAPAN 0.100000% 16-20.12.26* | JPY | 280 000 000 | | | 280 000 000 | 1 662 132 | 0,14 |
| JAPAN 0.100000% 17-20.06.27* | JPY | 250 000 000 | | | 250 000 000 | 1 482 336 | 0,12 |
| JAPAN 0.100000% 17-20.09.27* | JPY | 300 000 000 | | | 300 000 000 | 1 777 410 | 0,15 |
| JAPAN 0.100000% 17-20.12.27* | JPY | 250 000 000 | | | 250 000 000 | 1 479 420 | 0,12 |
| JAPAN 0.100000% 18-20.03.28* | JPY | 260 000 000 | | | 260 000 000 | 1 536 538 | 0,13 |
| JAPAN 0.100000% 18-20.06.28* | JPY | 90 000 000 | | | 90 000 000 | 531 391 | 0,04 |
| JAPAN 0.100000% 18-20.09.28* | JPY | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 589 352 | 0,05 |
| JAPAN 0.100000% 19-20.12.23* | JPY | 400 000 000 | | 400 000 000 | | | |
| JAPAN 0.100000% 19-20.03.24* | JPY | 150 000 000 | | 150 000 000 | | | |
| JAPAN 0.100000% 19-20.06.24* | JPY | 280 000 000 | | 280 000 000 | | | |
| JAPAN 0.100000% 19-20.09.24* | JPY | 330 000 000 | | 330 000 000 | | | |
| JAPAN 0.100000% 19-20.12.28* | JPY | 250 000 000 | | | 250 000 000 | 1 470 627 | 0,12 |
| JAPAN 0.100000% 19-20.03.29* | JPY | 290 000 000 | | | 290 000 000 | 1 703 459 | 0,14 |
| JAPAN 0.100000% 19-20.06.29* | JPY | 250 000 000 | | | 250 000 000 | 1 466 788 | 0,12 |
| JAPAN 0.100000% 19-20.09.29* | JPY | 200 000 000 | | | 200 000 000 | 1 172 323 | 0,10 |
| JAPAN 0.100000% 20-20.03.25* | JPY | | 200 000 000 | | 200 000 000 | 1 190 808 | 0,10 |
| JAPAN 0.100000% 20-20.06.25* | JPY | 280 000 000 | | | 280 000 000 | 1 666 965 | 0,14 |
| JAPAN 0.100000% 20-20.12.25* | JPY | 320 000 000 | | | 320 000 000 | 1 902 684 | 0,16 |
| JAPAN 0.100000% 20-20.06.30* | JPY | | 200 000 000 | 100 000 000 | 100 000 000 | 583 960 | 0,05 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|-----------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| JAPAN 0.10000% 20-20.09.30* | JPY 260 000 000 | | 260 000 000 | | | | |
| JAPAN 0.10000% 21-20.12.30* | JPY 200 000 000 | | | 200 000 000 | 1 163 266 | 0,10 | |
| JAPAN 0.10000% 21-20.03.31* | JPY 200 000 000 | | | 200 000 000 | 1 160 742 | 0,10 | |
| JAPAN 0.10000% 21-20.06.31* | JPY 250 000 000 | | | 250 000 000 | 1 447 848 | 0,12 | |
| JAPAN 0.10000% 21-20.09.31* | JPY 220 000 000 | | | 220 000 000 | 1 270 178 | 0,11 | |
| JAPAN 0.10000% 22-20.03.27* | JPY 200 000 000 | | | 200 000 000 | 1 186 464 | 0,10 | |
| JAPAN 0.10000% 22-20.09.27* | JPY | 200 000 000 | | 200 000 000 | 1 184 940 | 0,10 | |
| JAPAN 0.10000% 23-20.03.28* | JPY | 200 000 000 | | 200 000 000 | 1 181 953 | 0,10 | |
| JAPAN 0.10000% 23-20.06.28* | JPY | 300 000 000 | | 300 000 000 | 1 771 536 | 0,15 | |
| JAPAN 0.20000% 16-20.06.36* | JPY 150 000 000 | | | 150 000 000 | 820 066 | 0,07 | |
| JAPAN 0.20000% 22-20.06.32* | JPY 150 000 000 | | | 150 000 000 | 866 334 | 0,07 | |
| JAPAN 0.20000% 22-20.09.32* | JPY 250 000 000 | | | 250 000 000 | 1 440 052 | 0,12 | |
| JAPAN 0.30000% 14-20.12.24* | JPY 90 000 000 | | 90 000 000 | | | | |
| JAPAN 0.30000% 16-20.06.46* | JPY 80 000 000 | | | 80 000 000 | 365 277 | 0,03 | |
| JAPAN 0.30000% 19-20.06.39* | JPY 140 000 000 | 150 000 000 | 140 000 000 | 150 000 000 | 786 616 | 0,07 | |
| JAPAN 0.30000% 23-20.12.27* | JPY 200 000 000 | | | 200 000 000 | 1 192 260 | 0,10 | |
| JAPAN 0.30000% 23-20.09.28* | JPY | 300 000 000 | | 300 000 000 | 1 783 659 | 0,15 | |
| JAPAN 0.40000% 15-20.03.25* | JPY 120 000 000 | | | 120 000 000 | 716 549 | 0,06 | |
| JAPAN 0.40000% 15-20.09.25* | JPY 300 000 000 | | | 300 000 000 | 1 793 282 | 0,15 | |
| JAPAN 0.40000% 16-20.03.56* | JPY 80 000 000 | | | 80 000 000 | 318 580 | 0,03 | |
| JAPAN 0.40000% 19-20.09.49* | JPY 30 000 000 | | | 30 000 000 | 132 581 | 0,01 | |
| JAPAN 0.40000% 20-20.03.40* | JPY 140 000 000 | | | 140 000 000 | 735 242 | 0,06 | |
| JAPAN 0.40000% 20-20.06.40* | JPY 150 000 000 | | | 150 000 000 | 784 492 | 0,06 | |
| JAPAN 0.40000% 20-20.09.40* | JPY 70 000 000 | 90 000 000 | | 160 000 000 | 832 716 | 0,07 | |
| JAPAN 0.40000% 20-20.12.49* | JPY 100 000 000 | | | 100 000 000 | 440 551 | 0,04 | |
| JAPAN 0.40000% 20-20.03.50* | JPY 30 000 000 | | | 30 000 000 | 131 410 | 0,01 | |
| JAPAN 0.40000% 21-20.06.41* | JPY 140 000 000 | | | 140 000 000 | 717 728 | 0,06 | |
| JAPAN 0.40000% 23-20.06.33* | JPY | 400 000 000 | 100 000 000 | 300 000 000 | 1 745 916 | 0,14 | |
| JAPAN 0.50000% 14-20.09.24* | JPY 300 000 000 | | 150 000 000 | 150 000 000 | 894 722 | 0,07 | |
| JAPAN 0.50000% 16-20.09.36* | JPY 150 000 000 | | | 150 000 000 | 848 132 | 0,07 | |
| JAPAN 0.50000% 18-20.06.38* | JPY 140 000 000 | | | 140 000 000 | 770 427 | 0,06 | |
| JAPAN 0.50000% 19-20.03.49* | JPY 60 000 000 | | | 60 000 000 | 275 193 | 0,02 | |
| JAPAN 0.50000% 19-20.03.59* | JPY 90 000 000 | | | 90 000 000 | 356 748 | 0,03 | |
| JAPAN 0.50000% 20-20.03.60* | JPY 30 000 000 | | | 30 000 000 | 117 511 | 0,01 | |
| JAPAN 0.50000% 21-20.03.41* | JPY 140 000 000 | | | 140 000 000 | 734 342 | 0,06 | |
| JAPAN 0.50000% 22-20.12.41* | JPY 140 000 000 | | | 140 000 000 | 723 777 | 0,06 | |
| JAPAN 0.50000% 23-20.12.32* | JPY 250 000 000 | 150 000 000 | | 400 000 000 | 2 358 382 | 0,20 | |
| JAPAN 0.50000% 23-20.03.33* | JPY | 550 000 000 | 250 000 000 | 300 000 000 | 1 765 180 | 0,15 | |
| JAPAN 0.60000% 14-20.06.24* | JPY 150 000 000 | | 150 000 000 | | | | |
| JAPAN 0.60000% 17-20.06.37* | JPY 80 000 000 | | | 80 000 000 | 453 251 | 0,04 | |
| JAPAN 0.60000% 17-20.09.37* | JPY 150 000 000 | | | 150 000 000 | 846 820 | 0,07 | |
| JAPAN 0.60000% 20-20.06.50* | JPY 40 000 000 | | | 40 000 000 | 184 357 | 0,02 | |
| JAPAN 0.60000% 20-20.09.50* | JPY 90 000 000 | | 90 000 000 | | | | |
| JAPAN 0.70000% 17-20.03.37* | JPY 80 000 000 | | | 80 000 000 | 460 626 | 0,04 | |
| JAPAN 0.70000% 18-20.09.38* | JPY 70 000 000 | | | 70 000 000 | 395 016 | 0,03 | |
| JAPAN 0.70000% 18-20.06.48* | JPY 130 000 000 | | | 130 000 000 | 635 098 | 0,05 | |
| JAPAN 0.70000% 19-20.12.48* | JPY | 150 000 000 | | 150 000 000 | 727 484 | 0,06 | |
| JAPAN 0.70000% 20-20.12.50* | JPY 100 000 000 | | | 100 000 000 | 470 177 | 0,04 | |
| JAPAN 0.70000% 21-20.03.51* | JPY | 70 000 000 | | 70 000 000 | 328 003 | 0,03 | |
| JAPAN 0.70000% 21-20.06.51* | JPY 100 000 000 | | | 100 000 000 | 466 910 | 0,04 | |
| JAPAN 0.70000% 21-20.09.51* | JPY | 140 000 000 | | 140 000 000 | 651 290 | 0,05 | |
| JAPAN 0.70000% 21-20.03.61* | JPY 90 000 000 | | | 90 000 000 | 375 371 | 0,03 | |
| JAPAN 0.80000% 17-20.03.47* | JPY 100 000 000 | | | 100 000 000 | 507 950 | 0,04 | |
| JAPAN 0.80000% 17-20.09.47* | JPY 120 000 000 | | | 120 000 000 | 605 855 | 0,05 | |
| JAPAN 0.80000% 17-20.12.47* | JPY | 60 000 000 | | 60 000 000 | 302 085 | 0,02 | |
| JAPAN 0.80000% 18-20.03.48* | JPY 80 000 000 | | | 80 000 000 | 401 523 | 0,03 | |
| JAPAN 0.80000% 18-20.03.58* | JPY | 70 000 000 | | 70 000 000 | 313 535 | 0,03 | |
| JAPAN 0.80000% 22-20.03.42* | JPY 160 000 000 | | | 160 000 000 | 869 614 | 0,07 | |
| JAPAN 0.80000% 23-20.09.33* | JPY | 320 000 000 | | 320 000 000 | 1 925 880 | 0,16 | |
| JAPAN 0.90000% 17-20.03.57* | JPY 40 000 000 | | | 40 000 000 | 186 726 | 0,02 | |
| JAPAN 0.90000% 22-20.06.42* | JPY 150 000 000 | | | 150 000 000 | 826 743 | 0,07 | |
| JAPAN 1.00000% 15-20.12.35* | JPY 100 000 000 | | | 100 000 000 | 604 147 | 0,05 | |
| JAPAN 1.00000% 22-20.03.52* | JPY 120 000 000 | | | 120 000 000 | 602 148 | 0,05 | |
| JAPAN 1.00000% 22-20.03.62* | JPY 110 000 000 | | | 110 000 000 | 504 108 | 0,04 | |
| JAPAN 1.10000% 03-20.03.33* | JPY 70 000 000 | | | 70 000 000 | 433 509 | 0,04 | |
| JAPAN 1.10000% 23-20.03.43* | JPY | 190 000 000 | | 190 000 000 | 1 074 165 | 0,09 | |
| JAPAN 1.10000% 23-20.06.43* | JPY | 170 000 000 | | 170 000 000 | 957 827 | 0,08 | |
| JAPAN 1.20000% 14-20.12.34* | JPY 160 000 000 | | | 160 000 000 | 992 973 | 0,08 | |
| JAPAN 1.20000% 15-20.09.35* | JPY 80 000 000 | | | 80 000 000 | 494 515 | 0,04 | |
| JAPAN 1.20000% 23-20.06.53* | JPY | 60 000 000 | | 60 000 000 | 314 807 | 0,03 | |
| JAPAN 1.30000% 23-20.03.63* | JPY | 50 000 000 | | 50 000 000 | 250 678 | 0,02 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| JAPAN 1.40000% 15-20.09.45* | JPY | 40 000 000 | | | 40 000 000 | 233 136 | 0,02 |
| JAPAN 1.40000% 15-20.03.55* | JPY | 30 000 000 | | | 30 000 000 | 163 763 | 0,01 |
| JAPAN 1.40000% 22-20.09.52* | JPY | 40 000 000 | | | 40 000 000 | 221 141 | 0,02 |
| JAPAN 1.40000% 23-20.12.42* | JPY | 160 000 000 | | | 160 000 000 | 954 094 | 0,08 |
| JAPAN 1.50000% 12-20.06.32* | JPY | 70 000 000 | | | 70 000 000 | 447 502 | 0,04 |
| JAPAN 1.50000% 14-20.09.34* | JPY | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 639 319 | 0,05 |
| JAPAN 1.50000% 14-20.06.34* | JPY | 80 000 000 | | | 80 000 000 | 511 265 | 0,04 |
| JAPAN 1.50000% 14-20.12.44* | JPY | 50 000 000 | | | 50 000 000 | 298 098 | 0,02 |
| JAPAN 1.50000% 15-20.03.45* | JPY | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 595 351 | 0,05 |
| JAPAN 1.50000% 23-20.09.43* | JPY | | 150 000 000 | 150 000 000 | | | |
| JAPAN 1.60000% 10-20.06.30* | JPY | 70 000 000 | | | 70 000 000 | 446 923 | 0,04 |
| JAPAN 1.60000% 13-20.12.33* | JPY | 60 000 000 | | | 60 000 000 | 387 105 | 0,03 |
| JAPAN 1.60000% 23-20.12.52* | JPY | 50 000 000 | 50 000 000 | 100 000 000 | | | |
| JAPAN 1.70000% 12-20.09.32* | JPY | 150 000 000 | | | 150 000 000 | 974 841 | 0,08 |
| JAPAN 1.70000% 13-20.06.33* | JPY | 70 000 000 | | | 70 000 000 | 455 747 | 0,04 |
| JAPAN 1.70000% 13-20.09.33* | JPY | 170 000 000 | | | 170 000 000 | 1 106 995 | 0,09 |
| JAPAN 1.70000% 14-20.03.44* | JPY | 120 000 000 | | | 120 000 000 | 743 444 | 0,06 |
| JAPAN 1.70000% 14-20.09.44* | JPY | 30 000 000 | | | 30 000 000 | 185 475 | 0,02 |
| JAPAN 1.80000% 12-20.03.32* | JPY | 150 000 000 | 100 000 000 | | 250 000 000 | 1 632 889 | 0,14 |
| JAPAN 1.80000% 13-20.09.43* | JPY | 60 000 000 | | | 60 000 000 | 379 410 | 0,03 |
| JAPAN 1.80000% 23-20.09.53* | JPY | | 70 000 000 | | 70 000 000 | 422 886 | 0,03 |
| JAPAN 1.90000% 12-20.09.42* | JPY | 140 000 000 | | 140 000 000 | | | |
| JAPAN 1.90000% 13-20.03.53* | JPY | 40 000 000 | 40 000 000 | | 80 000 000 | 494 996 | 0,04 |
| JAPAN 2.10000% 09-20.03.29* | JPY | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 645 812 | 0,05 |
| JAPAN 2.10000% 09-20.09.29* | JPY | 90 000 000 | | | 90 000 000 | 585 553 | 0,05 |
| JAPAN 2.10000% 10-20.03.30* | JPY | 150 000 000 | | | 150 000 000 | 982 777 | 0,08 |
| JAPAN 2.10000% 10-20.12.30* | JPY | 70 000 000 | | | 70 000 000 | 462 204 | 0,04 |
| JAPAN 2.20000% 09-20.09.39* | JPY | 70 000 000 | | | 70 000 000 | 477 122 | 0,04 |
| JAPAN 2.20000% 11-20.03.31* | JPY | 60 000 000 | | | 60 000 000 | 399 528 | 0,03 |
| JAPAN 2.30000% 09-20.03.39* | JPY | 150 000 000 | | | 150 000 000 | 1 035 973 | 0,09 |
| JAPAN GOVERNMENT 0.10000% 22-20.12.31* | JPY | 230 000 000 | | | 230 000 000 | 1 324 327 | 0,11 |
| JAPAN GOVERNMENT FIVE YEAR BOND 0.00500% 20.09.26* | JPY | 300 000 000 | | | 300 000 000 | 1 777 000 | 0,15 |
| JAPAN GOVERNMENT TEN YEAR BOND TB 0.20000% 22-20.03.32* | JPY | 230 000 000 | 200 000 000 | | 430 000 000 | 2 490 631 | 0,21 |
| JAPAN GOVERNMENT THIRTY YEAR BOND 0.70000% 22-20.12.51* | JPY | 80 000 000 | | | 80 000 000 | 370 947 | 0,03 |
| JAPAN GOVERNMENT THIRTY YEAR BOND 1.30000% 22-20.06.52* | JPY | 80 000 000 | | | 80 000 000 | 432 231 | 0,04 |
| TOTAL JPY | | | | | | 102 951 342 | 8,52 |
| KRW | | | | | | | |
| KOREA TREASURY BOND 1.75000% 21-10.09.26* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 642 930 | 0,05 |
| KOREA TREASURY BOND 1.87500% 21-10.03.51* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 503 830 | 0,04 |
| KOREA, REPUBLIC OF 0.87500% 20-10.12.23* | KRW | 1 500 000 000 | | 1 500 000 000 | | | |
| KOREA, REPUBLIC OF 1.87500% 21-10.12.24* | KRW | 1 400 000 000 | | | 1 400 000 000 | 925 041 | 0,08 |
| KOREA, REPUBLIC OF 1.50000% 20-10.03.50* | KRW | 600 000 000 | | | 600 000 000 | 284 489 | 0,02 |
| KOREA, REPUBLIC OF 1.37500% 20-10.06.30* | KRW | | 1 000 000 000 | | 1 000 000 000 | 593 058 | 0,05 |
| KOREA, REPUBLIC OF 1.500000% 20-10.09.40* | KRW | 700 000 000 | | | 700 000 000 | 357 928 | 0,03 |
| KOREA, REPUBLIC OF 1.50000% 20-10.12.30* | KRW | 800 000 000 | | | 800 000 000 | 473 845 | 0,04 |
| KOREA, REPUBLIC OF 1.87500% 21-10.09.41* | KRW | 400 000 000 | | | 400 000 000 | 214 995 | 0,02 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.37500% 22-10.03.27* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 649 818 | 0,05 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.62500% 18-10.03.48* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 591 380 | 0,05 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.37500% 18-10.09.38* | KRW | | 500 000 000 | | 500 000 000 | 294 660 | 0,02 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.37500% 18-10.12.28* | KRW | 1 400 000 000 | | | 1 400 000 000 | 894 543 | 0,07 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.00000% 19-10.03.49* | KRW | 500 000 000 | | | 500 000 000 | 260 378 | 0,02 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.00000% 21-10.06.31* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 607 888 | 0,05 |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.37500% 21-10.12.31* | KRW | 800 000 000 | | 800 000 000 | | | |
| KOREA, REPUBLIC OF 2.50000% 22-10.03.52* | KRW | 800 000 000 | 600 000 000 | | 1 400 000 000 | 796 500 | 0,07 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.00000% 12-10.12.42* | KRW | 300 000 000 | | | 300 000 000 | 189 275 | 0,02 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.12500% 22-10.06.25* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 666 405 | 0,06 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.37500% 22-10.06.32* | KRW | 500 000 000 | 400 000 000 | | 900 000 000 | 598 690 | 0,05 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.12500% 22-10.09.52* | KRW | | 500 000 000 | | 500 000 000 | 322 394 | 0,03 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.25000% 23-10.03.53* | KRW | 500 000 000 | | | 500 000 000 | 331 374 | 0,03 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.25000% 23-10.06.33* | KRW | 700 000 000 | | | 700 000 000 | 461 685 | 0,04 |
| KOREA, REPUBLIC OF 4.25000% 22-10.12.32* | KRW | 900 000 000 | | | 900 000 000 | 637 787 | 0,05 |
| KOREA, REPUBLIC OF 3.25000% 23-10.03.28* | KRW | 1 000 000 000 | | | 1 000 000 000 | 665 993 | 0,06 |
| TOTAL KRW | | | | | | 11 964 887 | 0,99 |
| NOK | | | | | | | |
| NORWAY, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.75000% 15-13.03.25* | NOK | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 162 173 | 0,01 |
| NORWAY, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.00000% 18-26.04.28* | NOK | 5 000 000 | | | 5 000 000 | 390 589 | 0,03 |
| TOTAL NOK | | | | | | 552 762 | 0,05 |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| NZD | | | | | | | |
| NEW ZEALAN, REPUBLIC OF 0.25000% 20-15.05.28* | NZD | 2 000 000 | | 2 000 000 | 911 464 | 0,08 | |
| NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41* | NZD | 300 000 | | 300 000 | 103 223 | 0,01 | |
| NEW ZEALAND LOC GOV FUNDAGENCY-REG-S 4.50000% 23-15.05.30* | NZD | | 500 000 | 500 000 | 263 297 | 0,02 | |
| NEW ZEALAND-REG-S 3.50000% 15-14.04.33* | NZD | 400 000 | | 400 000 | 198 867 | 0,02 | |
| TOTAL NZD | | | | | 1 476 850 | 0,12 | |
| PLN | | | | | | | |
| POLAND, REPUBLIC OF 2.75000% 19-25.10.29* | PLN | 3 500 000 | | 3 500 000 | 695 369 | 0,06 | |
| POLAND, REPUBLIC OF 0.75000% 20-25.04.25* | PLN | 3 000 000 | | 3 000 000 | 647 291 | 0,05 | |
| POLAND, REPUBLIC OF 0.25000% 21-25.10.26* | PLN | 1 500 000 | | 1 500 000 | 299 886 | 0,02 | |
| POLAND, REPUBLIC OF 3.75000% 22-25.05.27* | PLN | | 2 000 000 | 2 000 000 | 432 630 | 0,04 | |
| POLAND, REPUBLIC OF 6.00000% 22-25.10.33* | PLN | | 1 500 000 | 1 500 000 | 351 908 | 0,03 | |
| TOTAL PLN | | | | | 2 427 084 | 0,20 | |
| SEK | | | | | | | |
| SWEDEN, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.125000% 20-12.05.31* | SEK | 2 000 000 | 4 000 000 | 6 000 000 | 432 650 | 0,04 | |
| SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 2.50000% 13-12.05.25* | SEK | 2 000 000 | | 2 000 000 | 167 178 | 0,01 | |
| SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 1.00000% 15-12.11.26* | SEK | 5 000 000 | | 5 000 000 | 403 547 | 0,03 | |
| SWEDISH COVERED BOND CORP-REG-S 2.00000% 17-17.06.26* | SEK | 6 000 000 | | 6 000 000 | 491 493 | 0,04 | |
| TOTAL SEK | | | | | 1 494 868 | 0,12 | |
| SGD | | | | | | | |
| SINGAPORE, REPUBLIC OF 2.75000% 16-01.03.46* | SGD | 200 000 | | 200 000 | 127 337 | 0,01 | |
| SINGAPORE, REPUBLIC OF 3.00000% 09-01.09.24* | SGD | 300 000 | | 300 000 | | | |
| SINGAPORE, REPUBLIC OF 1.25000% 21-01.11.26* | SGD | 1 000 000 | | 1 000 000 | 634 007 | 0,05 | |
| SINGAPORE, REPUBLIC OF 1.87500% 20-01.03.50* | SGD | | 300 000 | 300 000 | 159 555 | 0,01 | |
| SINGAPORE, REPUBLIC OF 1.62500% 21-01.07.31* | SGD | 1 300 000 | | 1 300 000 | 785 075 | 0,06 | |
| SINGAPORE, REPUBLIC OF 1.87500% 21-01.10.51* | SGD | | 300 000 | 300 000 | 158 240 | 0,01 | |
| TOTAL SGD | | | | | 1 864 213 | 0,15 | |
| USD | | | | | | | |
| AFRICAN DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-14.03.28* | USD | 100 000 | | 100 000 | 89 718 | 0,01 | |
| ALBERTA, PROVINCE OF 1.30000% 20-22.07.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | 74 434 | 0,01 | |
| AMERICAN WATER CAPITAL CORP 6.59300% 08-15.10.37* | USD | 200 000 | | 200 000 | 203 452 | 0,02 | |
| BANCO SANTANDER SA 6.93800% 23-07.11.33* | USD | | 400 000 | 400 000 | 397 944 | 0,03 | |
| BANK OF MONTREAL-144A 4.68900% 23-28.06.28* | USD | | 250 000 | 250 000 | 224 048 | 0,02 | |
| BIOGEN INC 4.05000% 15-15.09.25* | USD | 100 000 | | 100 000 | 88 394 | 0,01 | |
| BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC STEP-UP/DOWN 00-15.12.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | 110 483 | 0,01 | |
| COMMONWEALTH EDISON CO 4.70000% 14-15.01.44* | USD | 100 000 | | 100 000 | 81 930 | 0,01 | |
| COMMONWEALTH EDISON CO 3.00000% 20-01.03.50* | USD | 100 000 | | 100 000 | 60 216 | 0,00 | |
| DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 1.87500% 19-02.10.24* | USD | 200 000 | | 200 000 | 176 797 | 0,01 | |
| DTE ELECTRIC CO 3.65000% 22-01.03.52* | USD | 250 000 | | 250 000 | 170 432 | 0,01 | |
| DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 2.95000% 16-01.12.26* | USD | 100 000 | | 100 000 | 85 855 | 0,01 | |
| DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 2.55000% 21-15.04.31* | USD | 400 000 | | 400 000 | 311 061 | 0,03 | |
| DUKE ENERGY PROGRESS INC 3.60000% 17-15.09.47* | USD | 400 000 | | 400 000 | 268 773 | 0,02 | |
| ENTERGY ARKANSAS LLC 2.65000% 20-15.06.51* | USD | 350 000 | 150 000 | 500 000 | 273 986 | 0,02 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.25000% 14-29.01.24* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.75000% 22-15.03.29* | USD | 500 000 | | 500 000 | 398 893 | 0,03 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75000% 22-15.08.25* | USD | 150 000 | | 150 000 | 131 271 | 0,01 | |
| FLORIDA POWER & LIGHT CO 3.95000% 18-01.03.48* | USD | | 200 000 | 200 000 | 147 665 | 0,01 | |
| GENERAL MOTORS CO 6.60000% 16-01.04.36* | USD | | 200 000 | 200 000 | 191 499 | 0,02 | |
| HESS CORP 6.00000% 09-15.01.40* | USD | | 150 000 | 150 000 | 142 586 | 0,01 | |
| ING GROEP NV-144A 4.62500% 18-06.01.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 178 143 | 0,01 | |
| INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 15-15.01.25* | USD | 300 000 | | 300 000 | 263 868 | 0,02 | |
| INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-20.07.28* | USD | 700 000 | | 700 000 | 550 853 | 0,05 | |
| INTERNATIONAL BANK RECONSTRUCTION & DLP 3.12500% 22-15.06.27* | USD | 500 000 | | 500 000 | 432 228 | 0,04 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-11.03.25* | USD | 200 000 | | 200 000 | 172 957 | 0,01 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | 73 292 | 0,01 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30* | USD | 100 000 | | 100 000 | 72 083 | 0,01 | |
| INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28* | USD | 200 000 | | 200 000 | 156 746 | 0,01 | |
| ISRAEL, STATE OF 2.87500% 16-16.03.26* | USD | 200 000 | | 200 000 | 171 639 | 0,01 | |
| ITALY, REPUBLIC OF 6.87500% 93-27.09.23* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | |
| JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.25000% 15-01.10.27* | USD | 100 000 | | 100 000 | 88 028 | 0,01 | |
| KINDER MORGAN INC 4.30000% 14-01.06.25* | USD | 500 000 | | 500 000 | 443 951 | 0,04 | |
| KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 2.75000% 22-01.03.25* | USD | 600 000 | | 600 000 | 528 319 | 0,04 | |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 3.00000% 22-20.05.27* | USD | 600 000 | | 600 000 | 517 283 | 0,04 | |
| LOUISVILLE GAS & ELECTRIC CO 4.25000% 19-01.04.49* | USD | | 200 000 | 200 000 | 150 987 | 0,01 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| LYB INTERNATIONAL FINANCE BV 4.87500% 14-15.03.44* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 79 729 | 0,01 | |
| MIDAMERICAN ENERGY CO 5.30000% 24-01.02.55* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 178 194 | 0,01 | |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 2.37500% 16-24.03.26* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 172 051 | 0,01 | |
| NORTHERN STATES POWER CO 5.35000% 09-01.11.39* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 179 739 | 0,01 | |
| PACIFIC GAS AND ELECTRIC 6.40000% 23-15.06.33* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 474 191 | 0,04 | |
| PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 386 879 | 0,03 | |
| PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33* | USD | 100 000 | 300 000 | | 400 000 | 445 058 | 0,04 | |
| PUBLIC SERVICE CO OF COLORADO 4.10000% 18-15.06.48* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 71 178 | 0,01 | |
| REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25* | USD | 200 000 | | 76 000 | 124 000 | 110 193 | 0,01 | |
| SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 3.00000% 22-15.03.32* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 312 974 | 0,03 | |
| SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 5.95000% 22-01.11.32* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 283 355 | 0,02 | |
| SOUTHERN CALIFORNIA 5.87500% 23-01.12.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 185 654 | 0,02 | |
| SOUTHERN CALIFORNIA GAS CO 3.75000% 12-15.09.42* | USD | 110 000 | | | 110 000 | 79 367 | 0,01 | |
| UNION ELECTRIC CO 3.90000% 22-01.04.52* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 142 465 | 0,01 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC 5.80000% 06-15.03.36* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 386 234 | 0,03 | |
| URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 229 | 0,01 | |
| TOTAL USD | | | | | | 11 091 302 | 0,92 | |
| Total Anleihen, fester Zins | | | | | | 310 203 773 | 25,66 | |

Anleihen, Nullcoupon

DKK

| | | | | | | | | |
|--|-----|-----------|-----------|--|-----------|----------------|-------------|--|
| DENMARK, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.00000% 21-15.11.31* | DKK | 1 500 000 | 4 000 000 | | 5 500 000 | 606 155 | 0,05 | |
| TOTAL DKK | | | | | | 606 155 | 0,05 | |

EUR

| | | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|-------------------|-------------|--|
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 21-20.02.31* | EUR | 350 000 | | 350 000 | | | | |
| AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 22-20.10.28* | EUR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 862 737 | 0,07 | |
| BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.00000% 20-22.10.27* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 708 734 | 0,06 | |
| BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 0.00000% 21-22.10.31* | EUR | 200 000 | 800 000 | | 1 000 000 | 795 160 | 0,07 | |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND-REG-S 0.00000% 22-15.02.2032* | EUR | 300 000 | 600 000 | | 900 000 | 736 123 | 0,06 | |
| CCEP FINANCE IRELAND DAC-REG-S 0.00000% 21-06.09.25* | EUR | 150 000 | | | 150 000 | 138 423 | 0,01 | |
| EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.00000% 21-20.07.26* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 727 869 | 0,06 | |
| EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 0.00000% 21-28.09.28* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 604 099 | 0,05 | |
| EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.00000% 20-16.12.24* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 284 660 | 0,02 | |
| EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 21-06.07.26* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 912 496 | 0,08 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 18-25.03.24* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 19-25.03.25* | EUR | 1 000 000 | 700 000 | 700 000 | 1 000 000 | 941 044 | 0,08 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 19-25.11.29* | EUR | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 260 790 | 0,10 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 20-25.02.26* | EUR | 1 200 000 | | | 1 200 000 | 1 104 723 | 0,09 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 20-25.11.30* | EUR | 1 600 000 | | | 1 600 000 | 1 308 931 | 0,11 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 21-25.02.27* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 629 368 | 0,05 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 22-25.05.32* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 548 182 | 0,05 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 22-25.02.25* | EUR | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | | |
| FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC-REG-S 0.00000% 21-01.10.25* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 276 669 | 0,02 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 19-15.08.29* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 690 350 | 0,06 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 19-15.08.50* | EUR | 750 000 | | | 750 000 | 388 910 | 0,03 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.02.30* | EUR | 1 100 000 | | | 1 100 000 | 939 370 | 0,08 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.08.30* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 253 637 | 0,02 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.11.27* | EUR | 400 000 | | | 400 000 | 356 857 | 0,03 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.02.31* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.05.36* | EUR | 500 000 | | | 500 000 | 365 759 | 0,03 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.11.28* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 700 594 | 0,06 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.31* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 827 827 | 0,07 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.52* | EUR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 495 240 | 0,04 | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 19-05.04.24* | EUR | 1 500 000 | | 1 500 000 | | | | |
| GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-09.10.26* | EUR | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 367 217 | 0,11 | |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO-REG-S 0.00000% 21-15.04.24* | EUR | 1 600 000 | | 800 000 | 800 000 | 777 216 | 0,06 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.00000% 21-01.08.26* | EUR | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 175 683 | 0,10 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.01.24* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| ITALY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.24* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.00000% 20-15.07.30* | EUR | 600 000 | | | 600 000 | 500 133 | 0,04 | |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.00000% 22-15.01.26* | EUR | | 900 000 | | 900 000 | 831 759 | 0,07 | |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.00000% 20-15.01.27* | EUR | 200 000 | | | 200 000 | 180 948 | 0,01 | |
| NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.00000% 20-15.01.52* | EUR | 250 000 | | | 250 000 | 119 999 | 0,01 | |
| NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 0.00000% 20-15.01.29* | EUR | 800 000 | | | 800 000 | 683 556 | 0,06 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA-144A-REG-S 0.00000% 21-20.04.25* | EUR | 700 000 | | 700 000 | | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF 0.00000% 20-31.01.25* | EUR | 700 000 | | | 700 000 | 661 659 | 0,05 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE 0.00000% 21-18.11.25* | EUR | 300 000 | | | 300 000 | 276 387 | 0,02 | |
| TOTAL EUR | | | | | | 23 433 112 | 1,94 | |
| Total Anleihen, Nullcoupon | | | | | | 24 039 267 | 1,99 | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| Anleihen, variabler Zins | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| BPCE SA-REG-S 4.625%/VAR 23-02.03.30* | EUR | 100 000 | | 100 000 | 100 976 | 0,01 | |
| DEUTSCHE BANK AG 1.375%/VAR 21-17.02.32* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 163 092 | 0,01 | |
| NN GROUP NV-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-PRP* | EUR | 200 000 | | 200 000 | 194 431 | 0,02 | |
| TOTAL EUR | | | | | 458 498 | 0,04 | |
| GBP | | | | | | | |
| AVIVA PLC-REG-S-SUB 4.375%/FLR 16-12.09.49* | GBP | 100 000 | | 100 000 | 106 597 | 0,01 | |
| TOTAL GBP | | | | | 106 597 | 0,01 | |
| USD | | | | | | | |
| BPCE SA-REG-S 2.045%/VAR 21-19.10.27* | USD | 250 000 | | 250 000 | 205 436 | 0,02 | |
| DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30* | USD | 200 000 | | 200 000 | 212 946 | 0,02 | |
| TOTAL USD | | | | | 418 382 | 0,03 | |
| Total Anleihen, variabler Zins | | | | | 983 477 | 0,08 | |
| Strip auf Anleihen, Nullcoupon | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF STRIP 0.00000% 22-31.05.25* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | 936 149 | 0,08 | |
| TOTAL EUR | | | | | 936 149 | 0,08 | |
| Total Strip auf Anleihen, Nullcoupon | | | | | 936 149 | 0,08 | |
| Treasury-Notes, fester Zins | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 3.00000% 23-25.05.54* | EUR | | 800 000 | 800 000 | 736 558 | 0,06 | |
| FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 2.50000% 23-24.09.26* | EUR | | 1 300 000 | 1 300 000 | 1 254 446 | 0,10 | |
| ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 4.50000% 23-01.10.53* | EUR | | 1 000 000 | 400 000 | 615 043 | 0,05 | |
| KINGDOM OF SPAIN-144A-REG-S 2.55000% 22-31.10.32* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF 144A-REG-S2.80000% 23-31.05.26* | EUR | | 500 000 | 500 000 | 484 012 | 0,04 | |
| SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 0.10000% 21-30.04.31* | EUR | 1 000 000 | | 1 000 000 | 800 232 | 0,07 | |
| TOTAL EUR | | | | | 3 890 291 | 0,32 | |
| GBP | | | | | | | |
| UNITED KINGDOM TREASURY GILT-REG-S 4.75000% 23-22.10.43* | GBP | | 580 000 | 580 000 | 692 052 | 0,06 | |
| TOTAL GBP | | | | | 692 052 | 0,06 | |
| USD | | | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 6.12500% 99-15.08.29* | USD | 400 000 | | 400 000 | 392 579 | 0,03 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30* | USD | 400 000 | | 400 000 | 398 700 | 0,03 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 06-15.02.36* | USD | 600 000 | | 600 000 | 562 142 | 0,05 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 08-15.05.38* | USD | 700 000 | | 700 000 | 650 267 | 0,05 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.25000% 09-15.05.39* | USD | 500 000 | | 500 000 | 449 382 | 0,04 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.62500% 10-15.02.40* | USD | 500 000 | | 500 000 | 466 605 | 0,04 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 11-15.11.41* | USD | 700 000 | | 700 000 | 529 685 | 0,04 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 13-15.05.43* | USD | 500 000 | | 500 000 | 357 835 | 0,03 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 13-15.11.43* | USD | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 140 645 | 0,09 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 14-15.08.44* | USD | 600 000 | | 600 000 | 442 596 | 0,04 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 15-15.02.45* | USD | 400 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45* | USD | 1 500 000 | | 1 500 000 | 1 051 655 | 0,09 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 16-15.05.46* | USD | 1 400 000 | | 1 400 000 | 909 679 | 0,08 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 17-15.02.47* | USD | 2 300 000 | | 2 300 000 | 1 629 694 | 0,13 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 17-15.05.47* | USD | 1 200 000 | | 1 200 000 | 849 008 | 0,07 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.11.47* | USD | | 800 000 | 800 000 | 538 393 | 0,04 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-15.02.48* | USD | 1 300 000 | | 1 300 000 | 915 825 | 0,08 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 18-15.08.48* | USD | 1 200 000 | | 1 200 000 | 843 562 | 0,07 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.37500% 18-15.11.48* | USD | 1 400 000 | | 1 400 000 | 1 053 756 | 0,09 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 19-15.05.49* | USD | 1 400 000 | | 1 400 000 | 959 182 | 0,08 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 19-15.11.49* | USD | 1 500 000 | | 1 500 000 | 925 416 | 0,08 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 20-15.08.50* | USD | 1 200 000 | | 1 200 000 | 570 776 | 0,05 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 20-15.08.40* | USD | 1 300 000 | | 1 300 000 | 724 821 | 0,06 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 20-15.05.40* | USD | 800 000 | | 800 000 | 450 209 | 0,04 | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 20-15.11.50* | USD | 800 000 | | 800 000 | 406 976 | 0,03 | |

| Titel | 31.3.2023 | | | 31.3.2024 | | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-----------|-----------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 20-15.11.40* | USD | 800 000 | | 800 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 21-15.02.51* | USD | | 1 700 000 | | 1 700 000 | 922 422 | 0,08 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 1.87500% 21-15.02.41* | USD | 1 300 000 | 1 600 000 | 1 300 000 | 1 600 000 | 1 004 675 | 0,08 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 21-15.05.51* | USD | 1 900 000 | | | 1 900 000 | 1 161 766 | 0,10 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 21-15.05.41* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 998 194 | 0,08 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 21-15.08.51* | USD | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 725 461 | 0,06 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 21-15.08.41* | USD | 1 400 000 | 1 000 000 | | 2 400 000 | 1 458 796 | 0,12 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 21-15.11.51* | USD | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 21-15.11.41* | USD | 1 700 000 | | | 1 700 000 | 1 074 225 | 0,09 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 22-15.02.52* | USD | 800 000 | 400 000 | | 1 200 000 | 710 948 | 0,06 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 22-15.02.42* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 004 896 | 0,08 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-15.05.52* | USD | 1 500 000 | 1 500 000 | 1 500 000 | 1 500 000 | 1 022 259 | 0,08 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.25000% 22-15.05.42* | USD | 1 700 000 | | | 1 700 000 | 1 301 571 | 0,11 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 22-15.08.52* | USD | 1 100 000 | 300 000 | | 1 400 000 | 979 476 | 0,08 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.37500% 22-15.08.42* | USD | 1 100 000 | 700 000 | | 1 800 000 | 1 400 363 | 0,12 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-15.11.52* | USD | 1 000 000 | 2 000 000 | 1 000 000 | 2 000 000 | 1 693 668 | 0,14 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-15.11.42* | USD | 1 700 000 | | | 1 700 000 | 1 442 309 | 0,12 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 23-15.02.53* | USD | | 1 300 000 | | 1 300 000 | 1 028 205 | 0,09 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-15.02.43* | USD | | 3 200 000 | 1 700 000 | 1 500 000 | 1 248 930 | 0,10 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 23-15.05.53* | USD | | 1 300 000 | | 1 300 000 | 1 028 754 | 0,09 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-15.05.43* | USD | | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 330 052 | 0,11 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 23-15.08.53* | USD | | 800 000 | | 800 000 | 692 526 | 0,06 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 23-15.08.43* | USD | | 3 000 000 | 1 200 000 | 1 800 000 | 1 602 008 | 0,13 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.75000% 23-15.11.53* | USD | | 1 200 000 | | 1 200 000 | 1 153 797 | 0,10 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.75000% 23-15.11.43* | USD | | 2 200 000 | 800 000 | 1 400 000 | 1 308 070 | 0,11 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 16-15.08.26* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 098 525 | 0,17 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.08.27* | USD | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 681 987 | 0,14 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.11.27* | USD | 2 500 000 | | 2 500 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 18-15.02.28* | USD | 1 400 000 | | | 1 400 000 | 1 190 345 | 0,10 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 18-31.03.25* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 199 566 | 0,18 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.05.28* | USD | | 2 200 000 | | 2 200 000 | 1 875 110 | 0,16 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.08.28* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 850 528 | 0,07 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 255 052 | 0,10 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 19-15.05.29* | USD | 1 800 000 | | | 1 800 000 | 1 483 136 | 0,12 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-30.06.24* | USD | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 14-15.02.24* | USD | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 14-15.11.24* | USD | 3 300 000 | | 3 300 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 15-15.02.25* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 191 894 | 0,18 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 15-15.11.25* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 297 800 | 0,11 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 14-15.05.24* | USD | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 118 932 | 0,18 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 19-31.08.24* | USD | 2 900 000 | | 2 900 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-30.11.26* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 585 765 | 0,05 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-31.01.27* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 076 536 | 0,17 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-15.02.30* | USD | 800 000 | | | 800 000 | 619 485 | 0,05 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 20-30.04.25* | USD | 2 300 000 | | | 2 300 000 | 1 971 752 | 0,16 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 279 592 | 0,11 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.07.27* | USD | 2 700 000 | | | 2 700 000 | 2 133 129 | 0,18 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30* | USD | | 3 200 000 | | 3 200 000 | 2 308 156 | 0,19 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.08.27* | USD | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 582 417 | 0,13 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.08.25* | USD | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 688 953 | 0,14 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-30.09.27* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 1 963 860 | 0,16 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.09.25* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 841 697 | 0,07 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30* | USD | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 458 078 | 0,12 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-31.01.26* | USD | 2 300 000 | | | 2 300 000 | 1 915 349 | 0,16 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 107 914 | 0,09 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 21-15.02.24* | USD | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TIGER STRIP 0.50000% 21-28.02.26* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 081 198 | 0,17 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 21-15.03.24* | USD | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.03.26* | USD | 2 400 000 | | | 2 400 000 | 2 002 932 | 0,17 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-15.04.24* | USD | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.04.28* | USD | 1 000 000 | 2 000 000 | | 3 000 000 | 2 395 686 | 0,20 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31* | USD | 1 300 000 | 2 500 000 | | 3 800 000 | 2 884 393 | 0,24 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.05.26* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 074 513 | 0,17 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.06.28* | USD | 1 900 000 | | | 1 900 000 | 1 510 917 | 0,12 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF TREASURY NOTE 0.37500% 21-15.07.24* | USD | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-15.08.31* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 100 525 | 0,09 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.08.26* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 469 994 | 0,20 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.09.28* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 790 259 | 0,07 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-31.10.26* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 068 092 | 0,17 | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-15.11.31* | USD | 1 300 000 | 1 500 000 | | 2 800 000 | 2 059 929 | 0,17 | | |

| Titel | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--|
| | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.11.26* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 484 560 | 0,21 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.500000% 21-30.11.28* | USD | 1 400 000 | | | 1 400 000 | 1 115 327 | 0,09 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 21-15.12.24* | USD | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 22-15.01.25* | USD | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 2 619 295 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 22-31.01.29* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 803 382 | 0,07 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-15.02.32* | USD | 2 700 000 | 2 400 000 | 5 100 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-28.02.29* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 806 901 | 0,07 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-28.02.27* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 257 110 | 0,10 |
| AMERICA, UNITED STATES OF TB 1.75000% 22-15.03.25* | USD | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 2 619 299 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 22-31.03.29* | USD | | 1 500 000 | | 1 500 000 | 1 238 216 | 0,10 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 22-31.03.27* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 131 950 | 0,18 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 22-30.04.24* | USD | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-30.04.29* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 844 828 | 0,07 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-30.04.27* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 573 117 | 0,21 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-15.05.32* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 226 658 | 0,10 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 22-31.05.24* | USD | 3 000 000 | | 3 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 22-31.05.27* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 133 797 | 0,18 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 22-15.07.25* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 198 975 | 0,18 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 22-31.07.24* | USD | 2 000 000 | | 2 000 000 | | | |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 22-31.07.27* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 138 459 | 0,18 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 22-31.07.29* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 248 296 | 0,10 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 22-15.08.25* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 640 564 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 22-15.08.32* | USD | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 050 206 | 0,09 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.25000% 22-15.10.25* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 2 233 191 | 0,18 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-31.10.29* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 335 059 | 0,11 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 22-30.11.29* | USD | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 1 768 890 | 0,15 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 22-30.11.27* | USD | 1 700 000 | | | 1 700 000 | 1 506 428 | 0,12 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-15.12.25* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 668 852 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-31.12.27* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 658 508 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-31.01.30* | USD | 2 200 000 | | | 2 200 000 | 1 906 768 | 0,16 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 23-15.02.26* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 668 535 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-15.02.33* | USD | | 2 400 000 | 800 000 | 1 600 000 | 1 364 842 | 0,11 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 23-28.02.30* | USD | | 2 300 000 | | 2 300 000 | 2 046 686 | 0,17 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 23-31.03.28* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 634 125 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-30.04.30* | USD | | 2 300 000 | | 2 300 000 | 1 990 688 | 0,16 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.37500% 23-15.05.33* | USD | | 2 900 000 | 1 200 000 | 1 700 000 | 1 434 414 | 0,12 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 23-15.07.26* | USD | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 2 248 408 | 0,19 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-15.08.33* | USD | | 1 600 000 | | 1 600 000 | 1 402 840 | 0,12 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 23-31.08.28* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 713 183 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.62500% 23-15.10.26* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 709 805 | 0,22 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.87500% 23-31.10.28* | USD | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 2 769 969 | 0,23 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 23-15.11.33* | USD | | 2 100 000 | | 2 100 000 | 1 933 437 | 0,16 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 23-30.11.30* | USD | | 3 400 000 | | 3 400 000 | 3 087 860 | 0,26 |
| AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32* | USD | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 1 162 906 | 0,10 |
| TOTAL USD | | | | | | 180 103 087 | 14,90 |
| Total Treasury-Notes, fester Zins | | | | | | 184 685 430 | 15,28 |
| Treasury-Notes, Nullcoupon | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| SPAIN, KINGDOM OF 0.00000% 21-31.01.27* | EUR | | 1 900 000 | | 1 900 000 | 1 703 889 | 0,14 |
| TOTAL EUR | | | | | | 1 703 889 | 0,14 |
| Total Treasury-Notes, Nullcoupon | | | | | | 1 703 889 | 0,14 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | 737 050 432 | 60,97 |

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Mortgage Backed Securities, fester Zins

USD

| | | | | | | | |
|---|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------|
| BBCMS MORTGAGE TRUST 2.03700% 20-01.04.53* | USD | 2 850 000 | 1 500 000 | | 4 350 000 | 3 300 553 | 0,27 |
| BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB 4.26100% 18-01.10.51* | USD | 1 450 000 | | | 1 450 000 | 1 235 398 | 0,10 |
| CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST-SUB 2.90200% 16-01.07.49* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 1 268 452 | 0,10 |
| COMM CCRE26 MORTGAGE TRUST-SUB 3.63000% 15-01.10.48* | USD | 1 250 000 | 545 000 | | 1 795 000 | 1 565 849 | 0,13 |
| COMM MORTGAGE TRUST-SUB 4.22800% 18-01.05.51* | USD | 1 900 000 | | 1 900 000 | | | |
| FANNIE MAE 1.50000% 21-01.08.36* | USD | 1 771 647 | | | 671 647 | 403 884 | 0,03 |
| FANNIE MAE 1.50000% 22-01.06.36* | USD | 175 000 | | | 175 000 | 109 558 | 0,01 |
| FANNIE MAE 1.50000% 22-01.08.36* | USD | 425 000 | | | 425 000 | 281 864 | 0,02 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|----------------------------------|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| FANNIE MAE 1.50000% 21-01.10.36* | USD | 520 000 | | | 520 000 | 317 862 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 1.50000% 20-01.01.51* | USD | | 1 250 000 | | 1 250 000 | 687 295 | 0,06 | |
| FANNIE MAE 1.50000% 20-01.12.50* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 378 643 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 1.50000% 21-01.04.36* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 137 307 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.02.51* | USD | 690 000 | | | 690 000 | 412 553 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.06.36* | USD | 775 000 | | | 775 000 | 462 371 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.05.36* | USD | | 550 000 | | 550 000 | 323 757 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.02.52* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 659 581 | 0,05 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.02.52* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 595 818 | 0,05 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.11.51* | USD | 825 000 | | | 825 000 | 523 446 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.02.52* | USD | 660 000 | | | 660 000 | 428 737 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.04.37* | USD | 350 000 | 400 000 | 350 000 | 400 000 | 249 096 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 20-01.07.50* | USD | | 550 000 | | 550 000 | 175 268 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 20-01.11.50* | USD | 1 300 000 | | | 1 300 000 | 766 623 | 0,06 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.09.51* | USD | 1 025 000 | | | 1 025 000 | 635 596 | 0,05 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.01.52* | USD | 325 000 | | | 325 000 | 206 904 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.11.51* | USD | 4 596 627 | | | 4 596 627 | 2 855 724 | 0,24 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 20-01.12.50* | USD | 745 000 | | | 745 000 | 410 373 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.02.51* | USD | | 2 525 000 | 500 000 | 2 025 000 | 1 224 716 | 0,10 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.03.52* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 636 520 | 0,05 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.12.36* | USD | 75 000 | | | 75 000 | 48 004 | 0,00 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 21-01.01.37* | USD | 613 885 | | | 613 885 | 382 449 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.02.37* | USD | 1 000 000 | 2 000 000 | | 3 000 000 | 1 894 520 | 0,16 | |
| FANNIE MAE 2.00000% 22-01.03.37* | USD | | 425 000 | 425 000 | | | | |
| FANNIE MAE 2.50000% 21-01.12.51* | USD | 225 000 | | | 225 000 | 138 425 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 22-01.02.52* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 135 604 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 20-01.12.50* | USD | | 475 000 | | 475 000 | 265 857 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 21-01.04.51* | USD | 690 000 | | | 690 000 | 378 940 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 21-01.10.51* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 159 689 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 22-01.02.36* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 437 541 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 22-01.02.52* | USD | 665 000 | | | 665 000 | 439 609 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 22-01.02.52* | USD | 1 000 000 | | 1 000 000 | | | | |
| FANNIE MAE 2.50000% 23-01.05.52* | USD | | 1 075 000 | | 1 075 000 | 752 237 | 0,06 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 22-01.09.50* | USD | 2 850 000 | | | 2 850 000 | 1 906 983 | 0,16 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 23-01.01.52* | USD | | 2 975 000 | 500 000 | 2 475 000 | 1 773 989 | 0,15 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 16-01.01.32* | USD | 1 020 000 | | | 1 020 000 | 189 195 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 21-01.07.36* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 139 178 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 2.50000% 20-01.09.50* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 604 785 | 0,05 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 13-01.05.43* | USD | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 500 351 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 16-01.11.46* | USD | 1 435 000 | | | 1 435 000 | 336 779 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 19-01.12.49* | USD | 1 190 000 | | | 1 190 000 | 336 198 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.06.37* | USD | 125 000 | | | 125 000 | 82 142 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.02.52* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 299 491 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 20-01.07.50* | USD | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 769 962 | 0,06 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 21-01.06.51* | USD | | 2 500 000 | | 2 500 000 | 1 580 686 | 0,13 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.05.52* | USD | 1 750 000 | | 1 750 000 | | | | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.02.52* | USD | 475 000 | | | 475 000 | 328 223 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 20-01.02.35* | USD | 1 250 000 | | | 1 250 000 | 292 903 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 21-01.09.50* | USD | 125 000 | | | 125 000 | 62 816 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 21-01.10.51* | USD | | 1 450 000 | | 1 450 000 | 898 444 | 0,07 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.06.51* | USD | 750 000 | | | 750 000 | 453 224 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.03.37* | USD | 1 125 000 | | | 1 125 000 | 771 850 | 0,06 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 22-01.12.50* | USD | 2 500 000 | | | 2 500 000 | 1 640 177 | 0,14 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 23-01.06.51* | USD | | 350 000 | | 350 000 | 258 733 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 23-01.11.38* | USD | | 225 000 | | 225 000 | 179 798 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 3.00000% 21-01.01.52* | USD | 475 000 | | | 475 000 | 304 574 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 23-01.06.52* | USD | | 1 225 000 | | 1 225 000 | 862 631 | 0,07 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 22-01.05.52* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 369 638 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 22-01.07.52* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 181 637 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 22-01.04.52* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 140 384 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 22-01.05.52* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 365 296 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 22-01.03.52* | USD | | 475 000 | | 475 000 | 319 588 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 18-01.02.48* | USD | 10 000 000 | | | 10 000 000 | 1 297 584 | 0,11 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 19-01.01.35* | USD | 2 046 294 | | | 2 046 294 | 333 401 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 19-01.01.50* | USD | 1 680 000 | | | 1 680 000 | 239 378 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 3.50000% 22-01.12.52* | USD | | 300 000 | 300 000 | | | | |
| FANNIE MAE 4.00000% 14-01.11.44* | USD | 11 725 000 | | | 11 725 000 | 1 251 928 | 0,10 | |
| FANNIE MAE 4.00000% 22-01.05.51* | USD | | 800 000 | | 800 000 | 517 921 | 0,04 | |
| FANNIE MAE 4.00000% 22-01.09.37* | USD | 525 000 | | | 525 000 | 349 187 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 4.00000% 18-01.03.48* | USD | 2 595 000 | | | 2 595 000 | 310 834 | 0,03 | |
| FANNIE MAE 4.00000% 22-01.07.52* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 456 388 | 0,04 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | | Davon ausgeliehen |
|---------------------------------------|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|----------------------|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | |
| FANNIE MAE 4.00000% 22-01.09.52* | USD | 1 225 000 | | | 1 225 000 | 939 117 | 0,08 |
| FANNIE MAE 4.00000% 23-01.07.53* | USD | | 1 075 000 | | 1 075 000 | 860 249 | 0,07 |
| FANNIE MAE 4.50000% 16-01.11.46* | USD | 1 700 000 | | | 1 700 000 | 280 293 | 0,02 |
| FANNIE MAE 4.50000% 22-01.07.52* | USD | 375 000 | | | 375 000 | 281 611 | 0,02 |
| FANNIE MAE 4.50000% 22-01.07.52* | USD | 800 000 | | | 800 000 | 640 719 | 0,05 |
| FANNIE MAE 5.00000% 22-01.10.52* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 406 532 | 0,03 |
| FANNIE MAE 5.00000% 23-01.03.53* | USD | | 974 679 | | 974 679 | 788 710 | 0,07 |
| FANNIE MAE 5.00000% 22-01.10.37* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 170 005 | 0,01 |
| FANNIE MAE 5.00000% 20-01.09.49* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 193 409 | 0,02 |
| FANNIE MAE 5.00000% 23-01.11.52* | USD | 175 000 | | | 175 000 | 144 095 | 0,01 |
| FANNIE MAE 5.50000% 23-01.03.53* | USD | | 900 000 | | 900 000 | 710 050 | 0,06 |
| FANNIE MAE 5.50000% 23-01.03.53* | USD | | 275 000 | | 275 000 | 229 612 | 0,02 |
| FANNIE MAE 5.50000% 22-01.08.52* | USD | 450 000 | | | 450 000 | 330 801 | 0,03 |
| FANNIE MAE 5.50000% 23-01.07.53* | USD | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 839 750 | 0,07 |
| FANNIE MAE 5.50000% 23-01.06.53* | USD | | 375 000 | | 375 000 | 321 065 | 0,03 |
| FANNIE MAE 5.50000% 23-01.06.53* | USD | | 700 000 | | 700 000 | 616 209 | 0,05 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.01.53* | USD | 475 000 | | | 475 000 | 382 263 | 0,03 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.03.53* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 211 820 | 0,02 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.07.53* | USD | | 725 000 | | 725 000 | 624 352 | 0,05 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.04.53* | USD | | 175 000 | | 175 000 | 147 367 | 0,01 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.05.53* | USD | | 825 000 | | 825 000 | 704 645 | 0,06 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.06.53* | USD | | 625 000 | | 625 000 | 538 894 | 0,04 |
| FANNIE MAE 6.00000% 23-01.06.53* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 386 075 | 0,03 |
| FANNIE MAE 6.00000% 22-01.11.52* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 154 640 | 0,01 |
| FANNIE MAE 6.50000% 23-01.10.53* | USD | | 800 000 | | 800 000 | 733 915 | 0,06 |
| FANNIE MAE 6.50000% 23-01.04.53* | USD | | 725 000 | | 725 000 | 588 016 | 0,05 |
| FANNIE MAE 6.50000% 22-01.01.53* | USD | | 575 000 | | 575 000 | 484 833 | 0,04 |
| FANNIE MAE 6.50000% 23-01.05.53* | USD | | 600 000 | | 600 000 | 504 810 | 0,04 |
| FANNIE MAE 6.50000% 23-01.05.53* | USD | | 420 150 | | 420 150 | 357 955 | 0,03 |
| FANNIE MAE POOL 1.50000% 20-01.09.35* | USD | 355 000 | | | 355 000 | 143 131 | 0,01 |
| FANNIE MAE POOL 1.50000% 21-01.10.51* | USD | 575 000 | | 575 000 | | | |
| FANNIE MAE POOL 2.50000% 22-01.03.52* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 642 626 | 0,05 |
| FANNIE MAE POOL 2.50000% 22-01.02.52* | USD | 3 925 000 | | | 3 925 000 | 2 568 714 | 0,21 |
| FREDDIE MAC 1.50000% 20-01.09.35* | USD | | 1 250 000 | | 1 250 000 | 495 167 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 1.50000% 21-01.10.36* | USD | 750 000 | | | 750 000 | 450 940 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 1.50000% 22-01.05.37* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 65 334 | 0,01 |
| FREDDIE MAC 1.50000% 20-01.11.50* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 213 376 | 0,02 |
| FREDDIE MAC 1.50000% 20-01.12.50* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 80 571 | 0,01 |
| FREDDIE MAC 1.50000% 21-01.04.51* | USD | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 1 115 515 | 0,09 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 20-01.07.35* | USD | 3 500 000 | | | 3 500 000 | 1 274 403 | 0,11 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 20-01.01.36* | USD | 775 000 | | | 775 000 | 369 845 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 22-01.01.52* | USD | | 4 125 000 | 975 000 | 3 150 000 | 2 042 748 | 0,17 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.05.51* | USD | 825 000 | | | 825 000 | 459 855 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.05.51* | USD | 710 000 | | | 710 000 | 408 347 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.11.51* | USD | 707 592 | | | 707 592 | 447 465 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 20-01.12.50* | USD | 720 000 | | | 720 000 | 406 860 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.03.51* | USD | | 750 000 | | 750 000 | 425 502 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 2.00000% 22-01.04.52* | USD | 1 875 000 | | | 1 875 000 | 1 241 704 | 0,10 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 20-01.08.35* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 209 994 | 0,02 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.06.37* | USD | 125 000 | | | 125 000 | 84 280 | 0,01 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.02.37* | USD | 1 789 759 | | | 1 789 759 | 1 157 340 | 0,10 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 20-01.09.50* | USD | 940 000 | | | 940 000 | 380 377 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.06.52* | USD | 430 000 | | | 430 000 | 295 008 | 0,02 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 20-01.09.50* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 503 774 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 21-01.10.51* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 582 355 | 0,05 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.01.52* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 329 154 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.04.52* | USD | | 600 000 | 600 000 | | | |
| FREDDIE MAC 2.50000% 21-01.12.51* | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 688 999 | 0,06 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.02.52* | USD | 650 000 | | | 650 000 | 418 054 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 2.50000% 22-01.03.37* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 205 563 | 0,02 |
| FREDDIE MAC 3.00000% 17-01.08.32* | USD | 1 205 000 | | | 1 205 000 | 172 265 | 0,01 |
| FREDDIE MAC 3.00000% 21-01.08.51* | USD | 275 000 | | | 275 000 | 186 172 | 0,02 |
| FREDDIE MAC 3.00000% 22-01.02.52* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 134 238 | 0,01 |
| FREDDIE MAC 3.00000% 23-01.01.52* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 222 450 | 0,02 |
| FREDDIE MAC 3.50000% 17-01.04.47* | USD | 2 645 000 | | | 2 645 000 | 305 186 | 0,03 |
| FREDDIE MAC 3.50000% 18-01.03.33* | USD | 1 330 000 | | | 1 330 000 | 162 446 | 0,01 |
| FREDDIE MAC 3.50000% 18-01.12.45* | USD | 3 750 000 | | | 3 750 000 | 491 717 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 3.50000% 20-01.04.35* | USD | 950 000 | | 950 000 | | | |
| FREDDIE MAC 3.50000% 22-01.05.52* | USD | 575 000 | | 575 000 | | | |
| FREDDIE MAC 3.50000% 22-01.06.52* | USD | | 700 000 | | 700 000 | 505 884 | 0,04 |
| FREDDIE MAC 3.50000% 19-01.08.49* | USD | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 488 371 | 0,04 |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| FREDDIE MAC 3.50000% 15-01.10.45* | USD | 1 445 000 | | | 1 445 000 | 277 599 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 3.50000% 23-01.09.50* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 341 355 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 3.50000% 22-01.06.37* | USD | 200 000 | | 200 000 | | | | |
| FREDDIE MAC 4.00000% 22-01.04.50* | USD | 1 750 000 | | 925 000 | 825 000 | 333 626 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 4.00000% 22-01.07.52* | USD | 275 000 | | | 275 000 | 209 149 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.08.47* | USD | 2 145 000 | | | 2 145 000 | 271 492 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 4.00000% 22-01.06.52* | USD | 225 000 | | | 225 000 | 173 089 | 0,01 | |
| FREDDIE MAC 4.00000% 22-01.09.52* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 272 053 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 4.50000% 23-01.06.53* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 246 968 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 4.50000% 22-01.10.52* | USD | 450 000 | | | 450 000 | 354 268 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 4.50000% 20-01.03.50* | USD | 2 000 000 | | | 2 000 000 | 414 225 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 4.50000% 22-01.06.52* | USD | | 1 150 000 | | 1 150 000 | 872 254 | 0,07 | |
| FREDDIE MAC 5.00000% 22-01.07.52* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 209 881 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 5.00000% 22-01.08.52* | USD | 425 000 | | | 425 000 | 338 586 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 5.00000% 23-01.05.53* | USD | | 350 000 | | 350 000 | 292 299 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 5.00000% 22-01.09.52* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 314 716 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 5.00000% 22-01.11.52* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 120 685 | 0,01 | |
| FREDDIE MAC 5.00000% 23-01.03.53* | USD | | 525 000 | | 525 000 | 417 334 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 5.50000% 22-01.04.50* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 134 183 | 0,01 | |
| FREDDIE MAC 5.50000% 23-01.05.53* | USD | | 175 000 | | 175 000 | 147 242 | 0,01 | |
| FREDDIE MAC 5.50000% 22-01.06.52* | USD | 840 000 | | | 840 000 | 571 192 | 0,05 | |
| FREDDIE MAC 5.50000% 22-01.11.52* | USD | 303 066 | | | 303 066 | 250 584 | 0,02 | |
| FREDDIE MAC 6.00000% 23-01.10.52* | USD | 675 000 | | | 675 000 | 546 658 | 0,05 | |
| FREDDIE MAC 6.50000% 23-01.04.53* | USD | | 940 132 | | 940 132 | 789 594 | 0,07 | |
| FREDDIE MAC 6.50000% 23-01.11.53* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 445 124 | 0,04 | |
| FREDDIE MAC POOL 5.00000% 22-01.08.52* | USD | 350 000 | | | 350 000 | 275 316 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 2.00000% 20-01.11.50* | USD | 830 000 | | | 830 000 | 405 545 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 2.00000% 20-01.12.50* | USD | 2 750 000 | | | 2 750 000 | 1 374 897 | 0,11 | |
| GINNIE MAE 2.00000% 22-01.05.52* | USD | 275 000 | | | 275 000 | 179 205 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 2.00000% 21-20.06.51* | USD | 4 470 000 | | | 4 470 000 | 2 494 574 | 0,21 | |
| GINNIE MAE 2.50000% 21-01.01.51* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 227 401 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 2.50000% 20-01.10.50* | USD | 1 010 000 | | | 1 010 000 | 408 371 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 2.50000% 20-01.11.50* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 287 517 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 2.50000% 21-01.06.51* | USD | 3 500 000 | | | 3 500 000 | 1 990 366 | 0,16 | |
| GINNIE MAE 2.50000% 22-01.03.52* | USD | 1 850 000 | | | 1 850 000 | 1 224 912 | 0,10 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 19-01.11.49* | USD | 8 325 000 | | | 8 325 000 | 1 431 399 | 0,12 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 20-01.01.50* | USD | 720 000 | | | 720 000 | 133 150 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 20-01.06.50* | USD | 1 075 000 | | | 1 075 000 | 283 148 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 20-01.08.50* | USD | 330 000 | | | 330 000 | 100 913 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 22-01.05.52* | USD | 325 000 | | | 325 000 | 229 056 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 21-01.07.51* | USD | 360 000 | | | 360 000 | 200 714 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 3.00000% 20-01.03.50* | USD | 9 775 000 | | 4 625 000 | 5 150 000 | 1 047 130 | 0,09 | |
| GINNIE MAE 3.50000% 15-20.05.45* | USD | 2 710 000 | | | 2 710 000 | 225 140 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 3.50000% 17-01.07.47* | USD | 3 310 000 | | | 3 310 000 | 420 205 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 3.50000% 20-01.11.50* | USD | 4 000 000 | | | 4 000 000 | 1 341 236 | 0,11 | |
| GINNIE MAE 3.50000% 22-01.09.52* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 188 868 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 3.50000% 22-20.10.52* | USD | 225 000 | | | 225 000 | 171 575 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 4.00000% 17-01.07.47* | USD | 1 935 000 | | | 1 935 000 | 197 140 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 4.00000% 18-01.10.48* | USD | 2 403 949 | | | 2 403 949 | 231 617 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 4.00000% 20-01.04.50* | USD | 3 800 000 | | 2 275 000 | 1 525 000 | 302 881 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 4.00000% 23-01.05.53* | USD | | 375 000 | | 375 000 | 304 350 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 4.00000% 22-01.09.52* | USD | 550 000 | | | 550 000 | 429 063 | 0,04 | |
| GINNIE MAE 4.00000% 23-01.10.53* | USD | | 225 000 | | 225 000 | 186 742 | 0,02 | |
| GINNIE MAE 4.50000% 17-01.10.47* | USD | 1 095 000 | | | 1 095 000 | 101 727 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 4.50000% 19-01.11.49* | USD | 900 000 | | | 900 000 | 124 334 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 4.50000% 22-01.10.52* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 482 656 | 0,04 | |
| GINNIE MAE 4.50000% 23-01.03.53* | USD | | 550 000 | | 550 000 | 456 095 | 0,04 | |
| GINNIE MAE 5.00000% 22-01.08.52* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 399 120 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 5.00000% 23-01.01.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 166 454 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 5.00000% 23-01.04.53* | USD | | 175 000 | | 175 000 | 148 810 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 5.00000% 23-01.08.53* | USD | | 375 000 | | 375 000 | 326 628 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 5.00000% 23-01.12.53* | USD | | 425 000 | | 425 000 | 373 342 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 5.50000% 23-01.05.53* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 388 092 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 5.50000% 22-01.09.52* | USD | 225 000 | | | 225 000 | 176 168 | 0,01 | |
| GINNIE MAE 5.50000% 22-01.12.52* | USD | | 450 000 | | 450 000 | 367 920 | 0,03 | |
| GINNIE MAE II 2.00000% 21-01.05.51* | USD | 850 000 | | | 850 000 | 468 394 | 0,04 | |
| GINNIE MAE II 2.00000% 21-20.12.51* | USD | 3 400 000 | | | 3 400 000 | 2 129 582 | 0,18 | |
| GINNIE MAE II 2.50000% 21-01.07.51* | USD | 755 000 | | | 755 000 | 445 878 | 0,04 | |
| GINNIE MAE II 2.50000% 22-01.02.52* | USD | 1 175 000 | | | 1 175 000 | 774 441 | 0,06 | |
| GINNIE MAE II 3.00000% 22-01.02.52* | USD | 677 160 | | | 677 160 | 457 524 | 0,04 | |
| GINNIE MAE II 3.00000% 18-20.11.46* | USD | 1 250 000 | | | 1 250 000 | 396 784 | 0,03 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| GINNIE MAE II 4.00000% 22-01.08.52* | USD | 725 000 | | | 725 000 | 562 034 | 0,05 | |
| GINNIE MAE II 4.50000% 22-01.08.52* | USD | 525 000 | | | 525 000 | 415 271 | 0,03 | |
| GINNIE MAE II POOL 2.00000% 21-01.01.52* | USD | 4 050 000 | | 2 900 000 | 1 150 000 | 729 744 | 0,06 | |
| GINNIE MAE II POOL 2.50000% 21-01.01.52* | USD | 3 000 000 | | 1 325 000 | 1 675 000 | 1 093 924 | 0,09 | |
| GINNIE MAE II POOL 3.50000% 22-01.01.52* | USD | 2 975 000 | | 1 050 000 | 1 925 000 | 1 340 259 | 0,11 | |
| WELLS FARGO COMM MORTGAGE TRT 2016-C34 3.09600% 16-01.06.49* | USD | 465 000 | 1 550 000 | | 2 015 000 | 1 710 323 | 0,14 | |
| WELLS FARGO COMM MRTG TRT-SUB 3.49800% 15-01.07.58* | USD | 500 000 | | 500 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 118 612 530 | 9,81 | |
| Total Mortgage Backed Securities, fester Zins | | | | | | 118 612 530 | 9,81 | |

Mortgage Backed Securities, variabler Zins

USD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|---------|--|--|-------------|--|
| FHLMC MULTIFAMILY STRUCTURED 3.329%/VAR 15-01.05.25* | USD | 350 000 | | 350 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | | 0,00 | |
| Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins | | | | | | | 0,00 | |

Notes, fester Zins

CAD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|--|---------|----------------|-------------|--|
| BANK OF MONTREAL 3.65000% 22-01.04.27* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 194 247 | 0,02 | |
| HYDRO ONE INC 4.91000% 22-27.01.28* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 203 804 | 0,02 | |
| MANITOBA, PROVINCE OF 2.05000% 20-05.09.52* | CAD | 250 000 | | | 250 000 | 102 755 | 0,01 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 3.75000% 22-02.12.53* | CAD | | 500 000 | | 500 000 | 304 261 | 0,03 | |
| TELLUS CORP-REG-S 2.85000% 21-13.11.31* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 174 179 | 0,01 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 979 246 | 0,08 | |

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|---------|------|--|
| 7-ELEVEN INC-144A 1.80000% 21-10.02.31* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 217 076 | 0,02 | |
| ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 2.95000% 20-25.01.30* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 162 203 | 0,01 | |
| AP MOLLER - MAERSK A/S-144A 5.87500% 23-14.09.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 185 343 | 0,02 | |
| APA INFRASTRUCTURE LTD-144A 5.00000% 15-23.03.35* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 168 800 | 0,01 | |
| APPALACHIAN POWER CO 4.50000% 22-01.08.32* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 253 428 | 0,02 | |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.52800% 21-18.11.27* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 240 322 | 0,02 | |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC 5.00000% 19-20.04.48* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 163 666 | 0,01 | |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 5.89600% 23-13.07.26* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 182 535 | 0,02 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC 2.53900% 22-01.02.32* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 223 288 | 0,02 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 4.60000% 23-01.05.53* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 194 892 | 0,02 | |
| BERRY GLOBAL INC 1.65000% 21-15.01.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 245 297 | 0,02 | |
| BMW US CAPITAL LLC-144A 3.90000% 20-09.04.25* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 133 181 | 0,01 | |
| BROADCOM INC-144A 2.45000% 21-15.02.31* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 303 723 | 0,03 | |
| BROADCOM INC-144A 3.13700% 21-15.11.35* | USD | 272 000 | 200 000 | | 472 000 | 343 463 | 0,03 | |
| BROOKLYN UNION GAS CO/THE-144A 6.38800% 23-15.09.33* | USD | | 250 000 | | 250 000 | 232 611 | 0,02 | |
| CARGIL INC-144A 4.00000% 22-22.06.32* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 83 668 | 0,01 | |
| CARGILL INC-144A 4.75000% 23-24.04.33* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 176 452 | 0,01 | |
| CARRIER GLOBAL CORP 6.20000% 24-15.03.54* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 198 357 | 0,02 | |
| CARRIER GLOBAL CORP-144A 6.20000% 23-15.03.54* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| CDP FINANCIAL INC-144A 3.15000% 14-24.07.24* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 223 558 | 0,02 | |
| CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 3.70000% 20-15.11.29* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 83 780 | 0,01 | |
| CINTAS CORP 4.00000% 22-01.05.32* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 212 408 | 0,02 | |
| COLUMBIA PIPELINES OPERATING CO LLC-144A 6.54400% 23-15.11.53* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 146 376 | 0,01 | |
| COMCAST CORP 2.88700% 22-01.11.51* | USD | 300 000 | 200 000 | | 500 000 | 292 333 | 0,02 | |
| COMCAST CORP 2.93700% 22-01.11.56* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 170 126 | 0,01 | |
| CONOCOPHILLIPS CO 2.40000% 22-07.03.25* | USD | 400 000 | | 356 000 | 44 000 | 38 581 | 0,00 | |
| CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 5.75000% 24-15.03.54* | USD | | 150 000 | | 150 000 | 135 332 | 0,01 | |
| CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.25000% 23-20.07.28* | USD | | 500 000 | | 500 000 | 445 797 | 0,04 | |
| DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH AMERI-144A 2.00000% 21-14.12.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 248 415 | 0,02 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA-144A 4.75000% 15-13.10.35* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 125 261 | 0,01 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE-144A 4.50000% 18-21.09.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 338 | 0,01 | |
| ERAC USA FINANCE LLC-144A 5.40000% 23-01.05.53* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 180 825 | 0,01 | |
| FANNIE MAE 0.50000% 20-17.06.25* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 213 545 | 0,02 | |
| FANNIE MAE 0.75000% 20-08.10.27* | USD | 700 000 | | | 700 000 | 555 833 | 0,05 | |
| FANNIE MAE 0.87500% 20-05.08.30* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 218 776 | 0,02 | |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-144A 5.70000% 23-14.03.28* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 182 879 | 0,02 | |
| FIRSTENERGY TRANSMISSION LLC-144A 4.55000% 19-01.04.49* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 152 426 | 0,01 | |
| GE CAPITAL FUNDING LLC 4.55000% 21-15.05.32* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 174 675 | 0,01 | |
| GE HEALTHCARE HOLDINGS LLC-144A 5.85700% 22-15.03.30* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC 5.85700% 23-15.03.30* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 187 515 | 0,02 | |
| HCA INC 3.37500% 23-15.03.29* | USD | | 100 000 | | 100 000 | 82 594 | 0,01 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| HCA INC-144A 3.37500% 22-15.03.29* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| INTEL CORP 4.00000% 12-15.12.32* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 126 269 | 0,01 | |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.83200% 21-15.10.27* | USD | 350 000 | | 350 000 | | | | |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES-144A 3.46800% 21-01.12.50* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 180 096 | 0,01 | |
| INTESA SANPAOLO SPA-144A 6.62500% 23-20.06.33* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 186 917 | 0,02 | |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.35000% 22-15.09.32* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| MAGALLANES INC-144A 5.05000% 22-15.03.42* | USD | 600 000 | | 600 000 | | | | |
| MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERCA LLC-144A 1.45000% 21-02.03.26* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 252 142 | 0,02 | |
| MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERCA LLC-144A 5.00000% 24-11.01.34* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 267 937 | 0,02 | |
| MICROSOFT CORP-144A 3.40000% 23-15.06.27* | USD | | 100 000 | | 100 000 | 86 831 | 0,01 | |
| NESTLE HOLDINGS INC-144A 4.12500% 22-01.10.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 264 557 | 0,02 | |
| NESTLE HOLDINGS INC-144A 4.85000% 23-14.03.33* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 272 602 | 0,02 | |
| NORDEA BANK ABP-144A 5.37500% 22-22.09.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 272 048 | 0,02 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.45000% 19-15.09.36* | USD | | 300 000 | | 300 000 | 288 115 | 0,02 | |
| ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-144A 0.87500% 21-21.09.26* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 205 149 | 0,02 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP 2.56500% 20-15.02.30* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 158 399 | 0,01 | |
| PARKER-HANNIFIN CORP 4.25000% 22-15.09.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 264 968 | 0,02 | |
| PHILLIPS 66 CO-144A 4.68000% 22-15.02.45* | USD | 220 000 | | 220 000 | | | | |
| PHILLIPS 66 COMPANY 4.68000% 23-15.02.45* | USD | 220 000 | | | 220 000 | 175 899 | 0,01 | |
| PINE STREET TRUST I-144A 4.57200% 19-15.02.29* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 85 604 | 0,01 | |
| REALTY INCOME CORP 2.20000% 21-15.06.28* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.60700% 21-13.12.51* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 114 650 | 0,01 | |
| ROGERS COMMUNI INC-144A 3.80000% 22-15.03.32* | USD | 100 000 | | 100 000 | | | | |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-144A 4.55000% 22-15.03.52* | USD | | 200 000 | 200 000 | | | | |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC 4.55000% 23-15.03.52* | USD | | 200 000 | | 200 000 | 151 575 | 0,01 | |
| S&P GLOBAL INC 2.90000% 23-01.03.32* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 117 741 | 0,01 | |
| SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.75000% 17-23.03.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 258 761 | 0,02 | |
| SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.15000% 21-11.03.31* | USD | 250 000 | 250 000 | | 500 000 | 379 369 | 0,03 | |
| SYNCHRONY BANK 5.62500% 22-23.08.27* | USD | 300 000 | | | 300 000 | 265 143 | 0,02 | |
| WARNERMEDIA HOLDINGS 5.05000% 23-15.03.42* | USD | | 600 000 | | 600 000 | 464 487 | 0,04 | |
| WEA FINANCE LLC-144A 4.62500% 18-20.09.48* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 63 631 | 0,01 | |
| TOTAL USD | | | | | | 12 856 570 | 1,06 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 13 835 816 | 1,14 | |
| Notes, variabler Zins | | | | | | | | |
| USD | | | | | | | | |
| BNP PARIBAS SA-144A 2.871%/VAR 21-19.04.32* | USD | 400 000 | 300 000 | | 700 000 | 534 547 | 0,04 | |
| COOPERATIEVE RABOBANK UA-144A 1.980%/VAR 21-15.12.27* | USD | 600 000 | | | 600 000 | 492 598 | 0,04 | |
| FIFTH THIRD BANCORP 4.337%/VAR 22-25.04.33* | USD | 100 000 | | | 100 000 | 82 214 | 0,01 | |
| SOCIETE GENERALE SA-144A 5.634%/VAR 24-19.01.30* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 358 745 | 0,03 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.418%/VAR 21-11.06.27* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 205 364 | 0,02 | |
| UBS GROUP AG-144A 3.179%/VAR 21-11.02.43* | USD | 400 000 | | | 400 000 | 263 568 | 0,02 | |
| UBS GROUP AG-144A 4.751%/VAR 22-12.05.28* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 176 512 | 0,01 | |
| TOTAL USD | | | | | | 2 113 548 | 0,17 | |
| Total Notes, variabler Zins | | | | | | 2 113 548 | 0,17 | |
| Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | | | |
| AUD | | | | | | | | |
| TREASURY CORP OF VICTORIA 4.75000% 22-15.09.36* | AUD | 500 000 | | | 500 000 | 288 640 | 0,02 | |
| TOTAL AUD | | | | | | 288 640 | 0,02 | |
| CAD | | | | | | | | |
| BELL CANADA 3.60000% 17-29.09.27* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 321 102 | 0,03 | |
| CU INC 3.54800% 17-22.11.47* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 165 948 | 0,01 | |
| ENBRIDGE GAS INC 2.90000% 20-01.04.30* | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 184 171 | 0,02 | |
| ENBRIDGE INC 4.24000% 12-27.08.42* | CAD | 100 000 | | | 100 000 | 56 807 | 0,00 | |
| ENBRIDGE PIPELINES INC 4.33000% 19-22.02.49* | CAD | | 200 000 | | 200 000 | 112 995 | 0,01 | |
| HYDRO-QUEBEC 6.50000% 99-15.02.35* | CAD | | 400 000 | | 400 000 | 318 529 | 0,03 | |
| QUEBEC, PROVINCE OF 2.85000% 21-01.12.53* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 253 469 | 0,02 | |
| TRANSCANADA PIPELINES LTD-REG-S 4.18000% 18-03.07.48* | CAD | 400 000 | 100 000 | | 500 000 | 273 710 | 0,02 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 1 686 729 | 0,14 | |
| USD | | | | | | | | |
| NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.85000% 23-09.01.28* | USD | | 400 000 | | 400 000 | 359 014 | 0,03 | |
| TOTAL USD | | | | | | 359 014 | 0,03 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 2 334 383 | 0,19 | |

| Titel | | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|-------|--|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
|-------|--|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--|

Medium-Term Notes, variabler Zins

AUD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| NATIONAL AUSTRALIA BANK-SUB 6.322%/VAR 22-03.08.32* | AUD | 400 000 | | | 400 000 | 241 675 | 0,02 | |
| TOTAL AUD | | | | | | 241 675 | 0,02 | |

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE 3.992%/VAR 22-13.06.28* | USD | 500 000 | | | 500 000 | 436 922 | 0,04 | |
| COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA-144A-SUB 3.610%/VAR 19-12.09.34* | USD | 200 000 | | | 200 000 | 162 212 | 0,01 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 3.933%/VAR 19-02.08.34* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 206 612 | 0,02 | |
| TOTAL USD | | | | | | 805 746 | 0,07 | |

Total Medium-Term Notes, variabler Zins

1 047 421

0,09

Anleihen, fester Zins

CAD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|------------------|-------------|--|
| ALBERTA, PROVINCE OF 1.65000% 21-01.06.31* | CAD | 100 000 | | | 100 000 | 57 037 | 0,00 | |
| NOVA SCOTIA, PROVINCE OF 2.00000% 20-01.09.30* | CAD | 400 000 | | | 400 000 | 237 226 | 0,02 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 3.50000% 13-02.06.24* | CAD | 900 000 | | | 900 000 | 597 440 | 0,05 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 1.90000% 20-02.12.51* | CAD | 900 000 | | 500 000 | 400 000 | 164 636 | 0,01 | |
| ONTARIO, PROVINCE OF 2.25000% 21-02.12.31* | CAD | 800 000 | | | 800 000 | 471 521 | 0,04 | |
| PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA CAN 2.75000% 21-18.06.52* | CAD | 150 000 | 300 000 | | 450 000 | 224 660 | 0,02 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 1 752 519 | 0,14 | |

JPY

| | | | | | | | | |
|--|-----|-------------|--|--|-------------|------------------|-------------|--|
| JAPAN EXPRESSWAY HOLDING & DEBT AGENCY 0.37900% 15-26.12.25* | JPY | 80 000 000 | | | 80 000 000 | 477 443 | 0,04 | |
| WEST NIPPON EXPRESSWAY CO LTD 0.04000% 21-19.06.26* | JPY | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 590 616 | 0,05 | |
| TOTAL JPY | | | | | | 1 068 059 | 0,09 | |

MYR

| | | | | | | | | |
|--------------------------------|-----|-----------|-----------|-----------|-----------|------------------|-------------|--|
| MALAYSIA 3.58200% 22-15.07.32* | MYR | 4 000 000 | | | 4 000 000 | 747 202 | 0,06 | |
| MALAYSIA 3.72600% 19-31.03.26* | MYR | 2 500 000 | | 2 500 000 | | | | |
| MALAYSIA 3.82800% 19-05.07.34* | MYR | | 3 000 000 | | 3 000 000 | 568 908 | 0,05 | |
| MALAYSIA 4.06500% 20-15.06.50* | MYR | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 279 133 | 0,02 | |
| MALAYSIA 4.36900% 18-31.10.28* | MYR | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 589 175 | 0,05 | |
| MALAYSIA 4.66200% 22-31.03.38* | MYR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 204 679 | 0,02 | |
| MALAYSIA 4.6960% 22-15.10.42* | MYR | 1 500 000 | | | 1 500 000 | 308 404 | 0,03 | |
| MALAYSIA 4.76200% 17-07.04.37* | MYR | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 205 583 | 0,02 | |
| TOTAL MYR | | | | | | 2 903 086 | 0,24 | |

USD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|---------|---------|----------------|-------------|--|
| BPCE SA-144A 1.00000% 21-20.01.26* | USD | 250 000 | | | 250 000 | 208 704 | 0,02 | |
| CONSUMERS ENERGY CO 4.20000% 22-01.09.52* | USD | 150 000 | | | 150 000 | 113 871 | 0,01 | |
| FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 3.25000% 14-08.03.24* | USD | 250 000 | | 250 000 | | | | |
| FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 2.75000% 14-13.12.24* | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 3.25000% 18-16.11.28* | USD | 900 000 | | 900 000 | | | | |
| ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.60000% 23-01.06.52* | USD | 300 000 | | 100 000 | 200 000 | 158 464 | 0,01 | |
| TOTAL USD | | | | | | 481 039 | 0,04 | |

Total Anleihen, fester Zins

6 204 703

0,51

Weitere Anleihen, fester Zins

CAD

| | | | | | | | | |
|------------------------------------|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| HYDRO-QUEBEC 4.00000% 14-15.02.55* | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 315 880 | 0,03 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 315 880 | 0,03 | |

Total Weitere Anleihen, fester Zins

315 880

0,03

Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

144 464 281

11,95

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

Mortgage Backed Securities, fester Zins

USD

| | | | | | | | | |
|-----------------------------------|-----|---------|--|--|---------|--------|------|--|
| FANNIE MAE 2.50000% 22-01.04.37** | USD | 75 000 | | | 75 000 | 50 659 | 0,00 | |
| FANNIE MAE 5.00000% 22-01.10.50** | USD | 125 000 | | | 125 000 | 76 129 | 0,01 | |

| Titel | | 31.3.2023 | | 31.3.2024 | | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| | | Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | Anzahl/ Nominal | | | |
| FANNIE MAE POOL 2.00000% 20-01.12.50** | USD | 1 000 000 | | | 1 000 000 | 588 221 | 0,05 | |
| FANNIE MAE POOL 4.50000% 22-01.04.50** | USD | 750 000 | | | 750 000 | 438 022 | 0,04 | |
| FREDDIE MAC 1.50000% 22-01.04.37** | USD | | 145 000 | | 145 000 | 86 863 | 0,01 | |
| FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.08.36** | USD | 1 306 445 | | 625 000 | 681 445 | 413 940 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC 4.50000% 22-01.10.52** | USD | 825 000 | | | 825 000 | 647 116 | 0,05 | |
| FREDDIE MAC POOL 2.00000% 21-01.02.36** | USD | 550 000 | | | 550 000 | 310 660 | 0,03 | |
| FREDDIE MAC POOL 2.00000% 22-01.05.52** | USD | 500 000 | | | 500 000 | 327 549 | 0,03 | |
| GINNIE MAE 5.00000% 22-20.07.52** | USD | 375 000 | | | 375 000 | 297 474 | 0,02 | |
| GINNIE MAE II 2.50000% 22-20.06.52** | USD | 175 000 | | | 175 000 | 116 975 | 0,01 | |
| TOTAL USD | | | | | | 3 353 607 | 0,28 | |
| Total Mortgage Backed Securities, fester Zins | | | | | | 3 353 607 | 0,28 | |

Notes, fester Zins

CAD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|---------|---------|------------------|-------------|--|
| ALBERTA, PROVINCE OF GPN 2.95000% 21-01.06.52** | CAD | | 100 000 | | 100 000 | 51 780 | 0,00 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA/THE 2.95000% 22-08.03.27** | CAD | 800 000 | | | 800 000 | 508 260 | 0,04 | |
| FORTIS INC 2.18000% 21-15.05.28** | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 183 335 | 0,02 | |
| GREATER TORONTO AIRPORTS AUTHORITY 3.15000% 21-05.10.51** | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 102 992 | 0,01 | |
| HYDRO ONE INC 3.10000% 21-15.09.51** | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 150 299 | 0,01 | |
| INTER PIPELINE LTD 6.59000% 23-09.02.34** | CAD | | 300 000 | | 300 000 | 210 405 | 0,02 | |
| MANULIFE BANK OF CANADA 2.86400% 22-16.02.27** | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 190 584 | 0,02 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS 3.10000% 22-15.04.25** | CAD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| ROYAL BANK OF CANADA 1.78200% 21-20.05.26** | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 188 418 | 0,02 | |
| ROYAL BANK OF CANADA 1.58900% 21-04.05.26** | CAD | 600 000 | | | 600 000 | 376 225 | 0,03 | |
| TORONTO-DOMINION BANK 1.88800% 21-08.03.28** | CAD | 600 000 | | | 600 000 | 364 677 | 0,03 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 2 326 976 | 0,19 | |

USD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|---------|---------|---------|------------------|-------------|--|
| KONOCOPHILLIPS CO 4.02500% 22-15.03.62** | USD | 100 000 | | | 100 000 | 71 379 | 0,01 | |
| KENVUE INC 5.05000% 23-22.03.28** | USD | | 300 000 | | 300 000 | 273 113 | 0,02 | |
| NORTHERN TRUST CORP 4.00000% 22-10.05.27** | USD | | 200 000 | | 200 000 | 175 499 | 0,01 | |
| NXP BV / NXP FNDING LLC / NXP USA INC 4.30000% 22-18.06.29** | USD | 300 000 | | | 300 000 | 260 439 | 0,02 | |
| REALTY INCOME 3.10000% 21-15.12.29** | USD | 300 000 | | 300 000 | | | | |
| TOTAL USD | | | | | | 780 431 | 0,06 | |
| Total Notes, fester Zins | | | | | | 3 107 407 | 0,26 | |

Notes, variabler Zins

AUD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| AUST & NEW ZLAND BNK-SUB 6.405%/VAR 22-20.09.34** | AUD | 200 000 | | | 200 000 | 121 988 | 0,01 | |
| TOTAL AUD | | | | | | 121 988 | 0,01 | |

CAD

| | | | | | | | | |
|--|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| NATIONAL BANK OF CANADA-SUB 5.426%/VAR 22-16.08.32** | CAD | 300 000 | | | 300 000 | 202 029 | 0,02 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 202 029 | 0,02 | |
| Total Notes, variabler Zins | | | | | | 324 017 | 0,03 | |

Medium-Term Notes, fester Zins

AUD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.70000% 22-17.06.25** | AUD | 400 000 | | | 400 000 | 233 289 | 0,02 | |
| TOTAL AUD | | | | | | 233 289 | 0,02 | |

CAD

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|--|---------|----------------|-------------|--|
| 407 INTERNATIONAL INC-144A-REG-S 2.59000% 20-25.05.32** | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 116 555 | 0,01 | |
| ENBRIDGE INC 5.76000% 23-26.05.53** | CAD | | 150 000 | | 150 000 | 103 810 | 0,01 | |
| PEMBINA PIPELINE CORP 4.49000% 21-10.12.51** | CAD | 200 000 | | | 200 000 | 112 287 | 0,01 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 332 652 | 0,03 | |
| Total Medium-Term Notes, fester Zins | | | | | | 565 940 | 0,05 | |

Medium-Term Notes, variabler Zins

AUD

| | | | | | | | | |
|---|-----|--|---------|--|---------|----------------|-------------|--|
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-SUB 6.446%/VAR 23-25.10.33** | AUD | | 400 000 | | 400 000 | 244 044 | 0,02 | |
| TOTAL AUD | | | | | | 244 044 | 0,02 | |

| Titel | | 31.3.2023 Anzahl/ Nominal | Käufe ¹ | Verkäufe ² | 31.3.2024 Anzahl/ Nominal | Verkehrswert ³ in CHF | in % ³ | Davon ausgeliehen Anzahl/ Nominal |
|--|-----|---------------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
| USD | | | | | | | | |
| TRUIST FINANCIAL CORP-SUB 4.916%/VAR 22-28.07.33** | USD | 300 000 | | | 300 000 | 251 656 | 0,02 | |
| TOTAL USD | | | | | | 251 656 | 0,02 | |
| Total Medium-Term Notes, variabler Zins | | | | | | 495 701 | 0,04 | |

Anleihen, fester Zins

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|---------|--|---------|----------------|-------------|--|
| CAD | | | | | | | | |
| HYDRO-QUEBEC 3.40000% 23-01.09.29** | CAD | | 100 000 | | 100 000 | 64 969 | 0,01 | |
| NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 3.95000% 22-14.08.32** | CAD | 500 000 | | | 500 000 | 328 938 | 0,03 | |
| NEWFOUNDLAND, PROVINCE OF 2.85000% 17-02.06.28** | CAD | 400 000 | | | 400 000 | 254 682 | 0,02 | |
| PSP CAPITAL INC-REG-S 3.75000% 22-15.06.29** | CAD | | 500 000 | | 500 000 | 330 586 | 0,03 | |
| TOTAL CAD | | | | | | 979 175 | 0,08 | |

| | | | | | | | | |
|---|-----|-------------|-------------|--|-------------|------------------|-------------|--|
| JPY | | | | | | | | |
| JAPAN EXPRESSWAY HOLDING & DEBT AGENCY 0.13000% 17-30.06.27** | JPY | | 72 000 000 | | 72 000 000 | 426 446 | 0,04 | |
| MAJOR JOINT LOCAL GOVT BOND 0.13500% 20-25.04.30** | JPY | 100 000 000 | | | 100 000 000 | 582 394 | 0,05 | |
| MAJOR JOINT LOCAL GOVERNMENT BOND 0.70100% 23-25.05.33** | JPY | | 150 000 000 | | 150 000 000 | 890 094 | 0,07 | |
| MAJOR JOINT LOCAL GVT BONDS 0.19900% 22-25.03.32** | JPY | 50 000 000 | | | 50 000 000 | 287 329 | 0,02 | |
| TOTAL JPY | | | | | | 2 186 263 | 0,18 | |

| | | | | | | | | |
|---------------------------------|-----|-----------|-----------|--|-----------|----------------|-------------|--|
| MYR | | | | | | | | |
| MALAYSIA 3.65500% 19-15.10.24** | MYR | 3 000 000 | | | 3 000 000 | 571 506 | 0,05 | |
| MALAYSIA 5.35700% 22-15.05.52** | MYR | | 1 000 000 | | 1 000 000 | 223 719 | 0,02 | |
| TOTAL MYR | | | | | | 795 225 | 0,07 | |

| | | | | | | | | |
|---|-----|---------|--|--|---------|----------------|-------------|--|
| USD | | | | | | | | |
| NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 4.02300% 13-01.11.32** | USD | 100 000 | | | 100 000 | 83 085 | 0,01 | |
| PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 1.50000% 20-27.08.30** | USD | 400 000 | | | 400 000 | 286 998 | 0,01 | |
| TOTAL USD | | | | | | 370 083 | 0,02 | |

Total Anleihen, fester Zins **4 330 745** **0,35**

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden **12 177 417** **1,00**

Total Wertschriften **893 692 130** **73,92**

(davon ausgeliehen) 0,00

| | | | | | | | | |
|------------------------------|--|--|--|--|--|----------------------|---------------|--|
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | 328 506 238 | 27,17 | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | -19 519 926 | -1,61 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | 6 278 606 | 0,52 | |
| Gesamtfondsvermögen | | | | | | 1 208 957 048 | 100,00 | |

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten -300 596 478

Andere Verbindlichkeiten 0

Nettofondsvermögen **908 360 570**

| Bewertungskategorie | Verkehrswert per 31.3.2024 | in % des Gesamt- fondsvermögens ³ |
|--|-------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 881 505 937 | 72,92 |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern | -7 333 733 | -0,61 |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | - | - |
| TOTAL | 874 172 204 | 72,31 |

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

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

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

| Instrument | Anzahl/ Kontrakte | Währung | Deckung in CHF | Variation Margin in CHF | In % des Vermögens |
|---|----------------------|---------|-------------------|----------------------------|-----------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | | | |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306450) 3.00000% APR 24 11.04.24* | 600 000 | USD | 465 184 | -3 250 | 0.00 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0324438) 3.50000% APR 16 16.04.24* | 225 000 | USD | 192 509 | -1 139 | 0.00 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206460) 2.50000% JAN 23 11.04.24* | 525 000 | USD | 374 411 | -3 827 | 0.00 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606420) 6.00000% APR 24 11.04.24* | 400 000 | USD | 363 606 | -560 | 0.00 |
| | | | 1 395 710 | -8 776 | 0.00 |

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|----------------------------------|-----------------------|
| Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| KRW | 17 627 000 000 | USD | 13 264 005 | 03.04.2024 | 164 085 | 0.01 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 390 346 | 03.04.2024 | 63 679 | 0.01 |
| SEK | 46 370 000 | CHF | 3 939 802 | 03.04.2024 | 34 742 | 0.00 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 198 012 | 03.04.2024 | -31 752 | 0.00 |
| CAD | 41 700 000 | CHF | 26 919 456 | 03.04.2024 | -826 078 | -0.07 |
| HUF | 342 400 000 | CHF | 826 590 | 03.04.2024 | -18 133 | 0.00 |
| PLN | 10 680 000 | CHF | 2 349 712 | 03.04.2024 | -61 566 | -0.01 |
| DKK | 17 560 000 | CHF | 2 244 406 | 03.04.2024 | -45 169 | 0.00 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 207 349 | 03.04.2024 | -47 906 | 0.00 |
| AUD | 24 790 000 | CHF | 14 140 900 | 03.04.2024 | -421 926 | -0.03 |
| ILS | 5 540 000 | CHF | 1 357 675 | 03.04.2024 | -3 939 | 0.00 |
| NZD | 2 740 000 | CHF | 1 462 225 | 03.04.2024 | -13 395 | 0.00 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 710 488 | 03.04.2024 | -2 484 | 0.00 |
| GBP | 36 710 000 | CHF | 40 758 929 | 03.04.2024 | -994 791 | -0.08 |
| JPY | 18 738 700 000 | CHF | 110 057 640 | 03.04.2024 | -1 478 761 | -0.12 |
| USD | 526 055 000 | CHF | 461 285 004 | 03.04.2024 | -12 350 649 | -1.02 |
| EUR | 237 165 000 | CHF | 225 771 831 | 03.04.2024 | -4 874 479 | -0.40 |
| CHF | 2 000 595 | JPY | 339 400 000 | 03.04.2024 | 19 580 | 0.00 |
| CHF | 1 922 456 | EUR | 2 010 000 | 03.04.2024 | 32 297 | 0.00 |
| CHF | 4 282 948 | USD | 4 850 000 | 03.04.2024 | 83 769 | 0.01 |
| USD | 200 000 | CHF | 176 193 | 03.04.2024 | -3 877 | 0.00 |
| EUR | 185 000 | CHF | 178 669 | 03.04.2024 | -1 246 | 0.00 |
| EUR | 370 000 | CHF | 359 680 | 03.04.2024 | -150 | 0.00 |
| USD | 5 341 743 | IDR | 84 420 900 000 | 03.04.2024 | -19 840 | 0.00 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 336 677 | 03.05.2024 | 21 727 | 0.00 |
| KRW | 17 627 000 000 | USD | 13 078 835 | 03.05.2024 | -9 002 | 0.00 |
| USD | 13 059 939 | KRW | 17 627 000 000 | 03.04.2024 | 19 868 | 0.00 |
| CHF | 27 763 860 | CAD | 41 700 000 | 03.04.2024 | -18 326 | 0.00 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 229 515 | 03.05.2024 | 3 982 | 0.00 |
| CAD | 41 975 000 | CHF | 27 866 191 | 03.05.2024 | 17 000 | 0.00 |
| AUD | 25 100 000 | CHF | 14 714 938 | 03.05.2024 | 5 803 | 0.00 |
| DKK | 17 560 000 | CHF | 2 295 625 | 03.05.2024 | 10 147 | 0.00 |
| ILS | 5 540 000 | CHF | 1 359 973 | 06.05.2024 | 1 281 | 0.00 |
| HUF | 342 400 000 | CHF | 841 533 | 03.05.2024 | 1 223 | 0.00 |
| CHF | 846 107 | HUF | 342 400 000 | 03.04.2024 | -1 384 | 0.00 |
| CHF | 1 363 256 | ILS | 5 540 000 | 03.04.2024 | -1 642 | 0.00 |
| SEK | 46 370 000 | CHF | 3 922 281 | 03.05.2024 | 25 339 | 0.00 |
| CHF | 2 416 705 | PLN | 10 680 000 | 03.04.2024 | -5 427 | 0.00 |
| PLN | 10 680 000 | CHF | 2 407 148 | 06.05.2024 | 4 707 | 0.00 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit | Wiederbeschaffungswert in CHF | In % des Vermögens |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|----------------------------------|-----------------------|
| CHF | 2 265 613 | SGD | 3 380 000 | 03.04.2024 | -10 358 | 0.00 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 261 227 | 03.05.2024 | 10 266 | 0.00 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 716 092 | 03.05.2024 | 4 929 | 0.00 |
| NZD | 2 740 000 | CHF | 1 474 651 | 03.05.2024 | 3 807 | 0.00 |
| JPY | 18 338 500 000 | CHF | 109 867 956 | 07.05.2024 | 571 864 | 0.05 |
| CHF | 110 079 871 | JPY | 18 399 300 000 | 03.04.2024 | -563 645 | -0.05 |
| CHF | 471 819 072 | USD | 521 203 062 | 03.04.2024 | -2 551 879 | -0.21 |
| EUR | 239 085 000 | CHF | 233 064 122 | 03.05.2024 | 1 034 131 | 0.09 |
| GBP | 37 530 000 | CHF | 42 723 026 | 03.05.2024 | 169 228 | 0.01 |
| USD | 526 540 000 | CHF | 475 062 817 | 03.05.2024 | 2 540 112 | 0.20 |
| USD | 500 000 | CHF | 449 566 | 03.05.2024 | 861 | 0.00 |
| CHF | 451 115 | USD | 500 000 | 02.04.2024 | -765 | 0.00 |
| EUR | 1 300 000 | CHF | 1 264 632 | 03.05.2024 | 2 992 | 0.00 |
| | | | | | -19 511 150 | -1.61 |

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

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

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0506430) 5.00000% APR 23-13.04.23 | USD | 525 000 | 525 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0424428) 4.50000% APR 23 17.04.23 | USD | 250 000 | 0 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126437) 1.50000% APR 23 13.04.23 | USD | 550 000 | 325 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606420) 6.00000% APR 23-13.04.23 | USD | 250 000 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226427) 2.50000% APR 23-13.04.23 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204481) 2.00000% APR 23 17.04.23 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124523) 1.50000% MAY 21 16.05.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206536) 2.00000% MAY 21-11.05.23 | USD | 650 000 | 650 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526560) 5.50000% MAY 17 11.05.23 | USD | 275 000 | 275 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606594) 6.00000% MAY 14 11.05.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226591) 2.50000% MAY 13 11.05.23 | USD | 600 000 | 600 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326581) 3.50000% MAY 13 11.05.23 | USD | 475 000 | 475 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0526523) 5.50000% MAY 23-18.05.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204630) 2.00000% JUN 23-15.06.23 | USD | 400 000 | 400 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306609) 3.00000% JUN 22 13.06.23 | USD | 725 000 | 725 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124606) 1.50000% JUN 22 15.06.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226674) 2.50000% JUNE 23-13.06.23 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206619) 2.00000% JUNE 23-13.06.23 | USD | 1 550 000 | 1 550 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0406698) 4.00000% JUN 23-13.06.23 | USD | 700 000 | 700 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0224695) 2.50000% MAY 23-15.06.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506640) 5.00000% JUNE 21 20.06.23 | USD | 650 000 | 650 000 |
| FREDDIE MAC (TBA-US01F0626717) 6.50000% JUL 23-13.07.23 | USD | 625 000 | 625 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204713) 2.00000% JUL 23-18.07.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206791) 2.00000% MAY 23-13.07.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526727) 5.50000% JUL 23-13.07.23 | USD | 700 000 | 700 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226757) 4.00000% JULY 23-13.07.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124788) 1.50000% JUL 23 18.07.23 | USD | 100 000 | 100 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126841) 1.50000% AUG 21 14.08.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206874) 2.00000% AUG 23-14.08.23 | USD | 325 000 | 325 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204895) 2.00000% AUG 23-17.08.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0506844) 5.00000% AUG 23 14.08.23 | USD | 1 025 000 | 1 025 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206874) 2.00000% AUG 23-14.08.23 | USD | 675 000 | 675 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226831) 2.50000% AUG 23-14.08.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306864) 3.00000% AUG 22 14.08.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526800) 5.50000% AUG 23-14.08.23 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606834) 6.00000% AUG 06 14.08.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226914) 2.50000% SEP 23-14.09.23 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306948) 3.000000% SEP 23-14.09.23 | USD | 425 000 | 425 000 |

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|---|---------|---------------------|------------------------|
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206957) 2.00000% SEP 23-14.09.23 | USD | 325 000 | 325 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626972) 6.50000% SEPT 23-14.09.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0526945) 5.50000% SEP 23-21.09.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506988) 5.00000% SEP 23 21.09.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0406999) 4.00000% SEP 23-21.09.23 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526A56) 5.50000% OCT 23-12.10.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626A48) 6.50000% OCT 23-12.10.23 | USD | 575 000 | 575 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206A20) 2.00000% OCT 23-12.10.23 | USD | 900 000 | 900 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226A83) 2.50000% OCT 23-12.10.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0506A92) 5.00000% OCT 23-12.10.23 | USD | 350 000 | 350 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206B03) 2.00000% NOV 23-13.11.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226B66) 2.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606B66) 6.00000% NOV 23-13.11.23 | USD | 250 000 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204B21) 2.00000% NOV 23-15.11.23 | USD | 400 000 | 400 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326B57) 3.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626B21) 6.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 600 000 | 600 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526B30) 5.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 700 000 | 700 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326C31) 3.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 1 225 000 | 1 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0426C22) 4.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 1 025 000 | 1 025 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0406C67) 4.00000% DEC 23 13.12.23 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206C85) 2.00000% DEC 23 13.12.23 | USD | 3 875 000 | 3 875 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526C13) 5.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 975 000 | 975 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606C40) 6.00000% DEC 23 13.12.23 | USD | 475 000 | 475 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226C40) 2.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 2 750 000 | 2 750 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506C11) 5.00000% DEC 23 20.12.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0304C94) 3.00000% DEC 23-18.12.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204C04) 2.00000% DEC 23 18.12.23 | USD | 1 625 000 | 1 625 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126197) 1.50000% JAN 24 16.01.24 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626147) 6.50000% JAN 24 16.01.24 | USD | 825 000 | 825 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306112) 3.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 350 000 | 350 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606180) 6.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 825 000 | 825 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226187) 4.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206122) 2.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 250 000 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326177) 3.50000% JAN 24 16.01.24 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0504112) 5.00000% JAN 24 18.01.24 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204143) 2.00000% JAN 24 18.01.24 | USD | 350 000 | 350 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0406163) 4.00000% JAN 24 22.01.24 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206205) 2.00000% FEB 24 13.02.24 | USD | 925 000 | 925 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226260) 2.50000% FEB 24 13.02.24 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306294) 3.00000% FEB 24 13.02.24 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124291) 1.50000% FEB 2 15.02.24 | USD | 350 000 | 350 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506236) 5.00000% FEB 24 20.02.24 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206387) 2.00000% MAR 24 13.03.24 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226344) 2.50000% MAR 24 13.03.24 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626303) 6.50000% MAR 08 13.03.24 | USD | 500 000 | 500 000 |

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|--|---------|---------------------|------------------------|
| Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen | | | |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126437) 1.50000% APR 23 13.04.23 | USD | 325 000 | 550 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0424428) 4.50000% APR 23 17.04.23 | USD | 0 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226427) 2.50000% APR 23 13.04.23 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0506430) 5.00000% APR 23-13.04.23 | USD | 525 000 | 525 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204481) 2.00000% APR 23 17.04.23 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606420) 6.00000% APR 23 13.04.23 | USD | 250 000 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226591) 2.50000% MAY 23-11.05.23 | USD | 600 000 | 600 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526560) 5.50000% MAY 23 11.05.23 | USD | 275 000 | 275 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124523) 1.50000% MAY 21 16.05.23 | USD | 200 000 | 200 000 |

| Instrument | Wahrung | Kaufe/ Kontrakte | Verkaufe/ Kontrakte |
|---|----------|----------------------|-------------------------|
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326581) 3.50000% MAY 23 11.05.23 | USD | 475 000 | 475 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206536) 2.00000% MAY 23 11.05.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0426534) 4.50000% MAY 18 18.05.23 | USD | 550 000 | 550 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206536) 2.00000% MAY 22 11.05.23 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606594) 6.00000% MAY 14 11.05.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0526523) 5.50000% MAY 07 18.05.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306526) 3.00000% MAY 23 11.05.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0426654) 4.50000% JUNE 23 13.06.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206619) 2.00000% JUNE 23 13.06.23 | USD | 775 000 | 775 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506640) 5.00000% JUNE 23-20.06.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226674) 2.50000% JUNE 23-13.06.23 | USD | 1 500 000 | 1 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204630) 2.00000% JUN 23-15.06.23 | USD | 400 000 | 400 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306609) 3.00000% JUNE 23-13.06.23 | USD | 400 000 | 400 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124606) 1.50000% JUN 22 15.06.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206619) 2.00000% MAY 22 13.06.23 | USD | 1 125 000 | 1 125 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0406698) 4.00000% JUN 20 13.06.23 | USD | 700 000 | 700 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306609) 3.00000% JUN 22 13.06.23 | USD | 525 000 | 525 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326664) 3.50000% JUN 21 13.06.23 | USD | 700 000 | 700 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124606) 1.50000% JUN 22 15.06.23 | USD | 525 000 | 525 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126684) 1.50000% MAY 21 13.06.23 | USD | 475 000 | 475 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0224695) 2.50000% MAY 21 15.06.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506640) 5.00000% JUNE 21 20.06.23 | USD | 475 000 | 475 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306609) 3.00000% JUN 22 13.06.23 | USD | 325 000 | 325 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526727) 5.50000% JUL 23-13.07.23 | USD | 975 000 | 975 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206791) 5.50000% MAY 23-13.07.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FREDDIE MAC (TBA-US01F0626717) 6.50000% JUL 23-13.07.23 | USD | 625 000 | 625 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204713) 2.00000% JUL 23-18.07.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606750) 6.00000% JUL 23 13.07.23 | USD | 625 000 | 625 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226757) 4.00000% JULY 23-13.07.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124788) 1.50000% JUL 23 18.07.23 | USD | 100 000 | 100 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206874) 2.00000% AUG 21 14.08.23 | USD | 325 000 | 325 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306864) 3.00000% AUG 22 14.08.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204895) 2.00000% AUG 20 17.08.23 | USD | 600 000 | 600 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326821) 3.50000% AUG 22 14.08.23 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126841) 2.50000% AUG 21 14.08.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506806) 5.00000% AUG 22 21.08.23 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0506844) 5.00000% AUG 23-14.08.23 | USD | 1 025 000 | 1 025 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206874) 2.00000% AUG 23-14.08.23 | USD | 350 000 | 350 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226831) 2.50000% AUG 23-14.08.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526800) 5.50000% AUG 21 14.08.23 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606834) 6.00000% AUG 06 14.08.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306948) 3.000000% SEP 23-14.09.23 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206957) 2.00000% SEP 23-14.09.23 | USD | 325 000 | 325 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0406999) 4.00000% SEP 23-21.09.23 | USD | 375 000 | 375 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506988) 5.00000% SEP 23-21.09.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226914) 2.50000% SEP 23-14.09.23 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA US01F0626972) 6.50000% SEPT 23-14.09.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0526945) 5.50000% SEP 23-21.09.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0324A92) 3.50000% OCT 23-18.10.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206A20) 2.00000% OCT 23-12.10.23 | USD | 900 000 | 900 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526A56) 5.50000% OCT 23 12.10.23 | USD | 175 000 | 175 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226A83) 2.50000% OCT 23-12.10.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626A48) 6.50000% OCT 23-12.10.23 | USD | 575 000 | 575 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0506A92) 5.00000% OCT 23-12.10.23 | USD | 350 000 | 350 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326B57) 3.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 300 000 | 300 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206B03) 2.00000% NOV 23-13.11.23 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226B66) 2.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606B66) 6.00000% NOV 23-13.11.23 | USD | 250 000 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204B21) 2.00000% NOV 23-15.11.23 | USD | 400 000 | 400 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626B21) 6.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 600 000 | 600 000 |

| Instrument | Währung | Käufe/ Kontrakte | Verkäufe/ Kontrakte |
|--|---------|---------------------|------------------------|
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526B30) 5.50000% NOV 23-13.11.23 | USD | 700 000 | 700 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306C76) 3.00000% NOV 23 13.12.23 | USD | 2 125 000 | 2 125 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204C04) 2.00000% NOV 23 18.12.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0406C67) 4.00000% DEC 23 13.12.23 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0526C13) 5.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 975 000 | 975 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0426C22) 4.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 1 025 000 | 1 025 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204C04) 2.00000% DEC 23 18.12.23 | USD | 1 425 000 | 1 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326C31) 3.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 1 225 000 | 1 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206C85) 2.00000% DEC 23 13.12.23 | USD | 3 875 000 | 3 875 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226C40) 2.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 2 750 000 | 2 750 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606C40) 6.00000% DEC 23 13.12.23 | USD | 475 000 | 475 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0304C94) 3.00000% DEC 23-18.12.23 | USD | 225 000 | 225 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506C11) 5.00000% DEC 23 20.12.23 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626C04) 6.50000% DEC 23 13.12.23 | USD | 675 000 | 675 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606180) 6.00000% JAN 24-16.01.24 | USD | 825 000 | 825 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206122) 2.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 250 000 | 250 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204143) 2.00000% JAN 22 18.01.24 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306112) 3.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 350 000 | 350 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226187) 4.00000% JAN 24 16.01.24 | USD | 375 000 | 375 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506152) 5.00000% JAN 24 22.01.24 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0504112) 5.00000% JAN 24 18.01.24 | USD | 200 000 | 200 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0126197) 1.50000% JAN 24 16.01.24 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626147) 6.50000% JAN 24 16.01.24 | USD | 825 000 | 825 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0406163) 4.00000% JAN 24 22.01.24 | USD | 225 000 | 225 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0326177) 3.50000% JAN 24 16.01.24 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0204143) 2.00000% JAN 24 18.01.24 | USD | 125 000 | 125 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226260) 2.50000% FEB 24 13.02.24 | USD | 500 000 | 500 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506236) 5.00000% FEB 07 20.02.24 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306294) 3.00000% FEB 24 13.02.24 | USD | 1 075 000 | 1 075 000 |
| GINNIE MAE (TBA-US21H0506152) 5.00000% JAN 24 22.01.24 | USD | 425 000 | 425 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626220) 6.50000% FEB 08 31.02.24 | USD | 800 000 | 800 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206205) 2.00000% FEB 24 13.02.24 | USD | 925 000 | 925 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0124291) 1.50000% FEB 2 15.02.24 | USD | 350 000 | 350 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0226344) 2.50000% MAR 24 13.03.24 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0406367) 4.00000% FEB 23 13.03.24 | USD | 450 000 | 450 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206387) 2.00000% MAR 22 13.03.24 | USD | 375 000 | 375 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0626303) 6.50000% MAR 24 13.03.24 | USD | 500 000 | 500 000 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0306450) 3.00000% APR 24 11.04.24 | USD | 600 000 | 0 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0324438) 3.50000% APR 16 16.04.24 | USD | 225 000 | 0 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0206460) 2.50000% JAN 23 11.04.24 | USD | 525 000 | 0 |
| FANNIE MAE (TBA-US01F0606420) 6.00000% APR 24 11.04.24 | USD | 400 000 | 0 |

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|-------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| Devisentermingeschäfte | | | | |
| JPY | 241 400 000 | CHF | 1 662 415 | 02.05.2023 |
| KRW | 403 800 000 | USD | 307 428 | 03.05.2023 |
| GBP | 875 000 | CHF | 989 559 | 03.05.2023 |
| EUR | 4 365 000 | CHF | 4 335 191 | 03.05.2023 |
| USD | 6 900 000 | CHF | 6 296 457 | 03.05.2023 |
| CAD | 550 000 | CHF | 372 797 | 03.05.2023 |
| CZK | 8 060 000 | CHF | 340 381 | 03.05.2023 |
| AUD | 355 000 | CHF | 217 503 | 03.05.2023 |
| SGD | 220 000 | CHF | 147 474 | 03.05.2023 |
| USD | 10 604 064 | KRW | 14 178 800 000 | 03.05.2023 |
| USD | 4 985 383 | IDR | 73 875 900 000 | 03.05.2023 |
| USD | 10 286 760 | KRW | 13 775 000 000 | 03.05.2023 |
| USD | 301 546 | KRW | 403 800 000 | 03.05.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| KRW | 14 178 800 000 | USD | 10 588 306 | 03.05.2023 |
| USD | 5 038 940 | IDR | 73 875 900 000 | 03.05.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 5 038 940 | 03.05.2023 |
| CHF | 12 893 794 | AUD | 21 855 000 | 03.05.2023 |
| CHF | 1 116 126 | ILS | 4 525 000 | 03.05.2023 |
| CHF | 1 897 872 | DKK | 14 370 000 | 03.05.2023 |
| CHF | 711 211 | HUF | 270 000 000 | 03.05.2023 |
| CHF | 23 397 092 | CAD | 35 675 000 | 03.05.2023 |
| CHF | 398 802 659 | USD | 445 166 780 | 03.05.2023 |
| CHF | 1 260 712 | NZD | 2 295 000 | 03.05.2023 |
| KRW | 14 179 000 000 | USD | 10 621 451 | 02.06.2023 |
| AUD | 21 855 000 | CHF | 12 866 102 | 02.06.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 333 841 | 02.06.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 113 281 | 02.06.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 895 171 | 02.06.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 701 992 | 02.06.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 715 181 | 02.06.2023 |
| CAD | 35 675 000 | CHF | 23 329 666 | 02.06.2023 |
| USD | 447 675 000 | CHF | 399 643 949 | 02.06.2023 |
| GBP | 31 415 000 | CHF | 34 983 179 | 02.06.2023 |
| JPY | 16 209 900 000 | CHF | 106 953 117 | 02.06.2023 |
| EUR | 191 795 000 | CHF | 188 532 759 | 02.06.2023 |
| SEK | 35 140 000 | CHF | 3 037 222 | 02.06.2023 |
| NZD | 2 295 000 | CHF | 1 256 268 | 02.06.2023 |
| PLN | 6 760 000 | CHF | 1 443 057 | 02.06.2023 |
| USD | 9 555 000 | CHF | 8 506 032 | 02.06.2023 |
| CAD | 150 000 | CHF | 98 449 | 02.06.2023 |
| PLN | 1 790 000 | CHF | 382 931 | 02.06.2023 |
| JPY | 372 000 000 | CHF | 2 431 312 | 02.06.2023 |
| GBP | 315 000 | CHF | 351 714 | 02.06.2023 |
| AUD | 660 000 | CHF | 395 580 | 02.06.2023 |
| EUR | 4 075 000 | CHF | 4 003 716 | 02.06.2023 |
| USD | 900 000 | CHF | 804 902 | 02.06.2023 |
| KRW | 503 880 000 | USD | 381 054 | 02.06.2023 |
| USD | 100 000 | CHF | 89 165 | 02.06.2023 |
| JPY | 72 200 000 | CHF | 476 240 | 02.06.2023 |
| NZD | 170 000 | CHF | 94 579 | 02.06.2023 |
| SEK | 5 030 000 | CHF | 433 745 | 02.06.2023 |
| AUD | 500 000 | CHF | 297 872 | 02.06.2023 |
| CAD | 1 945 000 | CHF | 1 288 524 | 02.06.2023 |
| JPY | 801 500 000 | CHF | 5 273 866 | 02.06.2023 |
| GBP | 1 155 000 | CHF | 1 291 486 | 02.06.2023 |
| USD | 20 100 000 | CHF | 17 932 396 | 02.06.2023 |
| EUR | 9 650 000 | CHF | 9 381 112 | 02.06.2023 |
| CAD | 895 000 | CHF | 598 874 | 02.06.2023 |
| USD | 2 200 000 | CHF | 1 979 301 | 02.06.2023 |
| EUR | 1 950 000 | CHF | 1 902 278 | 02.06.2023 |
| USD | 575 000 | CHF | 516 965 | 02.06.2023 |
| AUD | 400 000 | CHF | 237 935 | 02.06.2023 |
| JPY | 151 750 000 | CHF | 988 555 | 02.06.2023 |
| EUR | 335 000 | CHF | 325 817 | 02.06.2023 |
| USD | 11 072 227 | KRW | 14 682 880 000 | 02.06.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 980 006 | 05.06.2023 |
| SGD | 3 110 000 | CHF | 2 078 697 | 05.06.2023 |
| SGD | 270 000 | CHF | 180 186 | 05.06.2023 |
| USD | 4 945 667 | IDR | 73 875 900 000 | 05.06.2023 |
| USD | 4 935 260 | IDR | 73 875 900 000 | 05.06.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 935 260 | 05.06.2023 |
| USD | 34 339 | CHF | 31 274 | 05.06.2023 |
| KRW | 14 683 000 000 | USD | 11 091 136 | 05.07.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 941 367 | 05.07.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 697 804 | 05.07.2023 |
| CAD | 38 155 000 | CHF | 25 401 542 | 05.07.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 872 607 | 05.07.2023 |
| PLN | 8 550 000 | CHF | 1 818 755 | 05.07.2023 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 265 978 | 05.07.2023 |
| JPY | 17 698 500 000 | CHF | 115 462 525 | 05.07.2023 |
| GBP | 31 690 000 | CHF | 35 606 092 | 05.07.2023 |
| AUD | 22 985 000 | CHF | 13 528 298 | 05.07.2023 |
| USD | 476 735 000 | CHF | 432 647 024 | 05.07.2023 |
| EUR | 209 075 000 | CHF | 202 978 373 | 05.07.2023 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 342 677 | 05.07.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 107 793 | 05.07.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 693 230 | 05.07.2023 |
| SEK | 40 170 000 | CHF | 3 338 709 | 05.07.2023 |
| KRW | 971 000 000 | USD | 737 243 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 600 000 | EUR | 1 646 079 | 05.07.2023 |
| USD | 573 490 | KRW | 729 000 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 23 657 458 | USD | 26 200 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 2 031 354 | CAD | 3 000 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 13 190 486 | EUR | 13 500 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 8 131 874 | JPY | 1 250 000 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 2 274 524 | GBP | 2 000 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 450 000 | USD | 502 265 | 05.07.2023 |
| CHF | 269 153 | USD | 300 000 | 05.07.2023 |
| USD | 4 922 435 | IDR | 73 875 900 000 | 05.07.2023 |
| USD | 11 391 999 | KRW | 14 925 000 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 189 420 074 | EUR | 193 928 921 | 05.07.2023 |
| CHF | 102 419 054 | JPY | 16 448 500 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 33 766 437 | GBP | 29 690 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 878 481 | PLN | 8 550 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 2 246 026 | SGD | 3 380 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 099 930 | ILS | 4 525 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 351 017 | NZD | 2 465 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 13 717 448 | AUD | 22 985 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 720 047 | NOK | 8 590 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 3 328 083 | SEK | 40 170 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 1 886 887 | DKK | 14 370 000 | 05.07.2023 |
| CHF | 711 686 | HUF | 270 000 000 | 05.07.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 303 987 | 07.07.2023 |
| CHF | 1 316 212 | CZK | 31 980 000 | 07.07.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 919 485 | 03.08.2023 |
| KRW | 14 925 000 000 | USD | 11 408 021 | 03.08.2023 |
| GBP | 29 690 000 | CHF | 33 674 754 | 03.08.2023 |
| JPY | 16 524 900 000 | CHF | 103 040 798 | 03.08.2023 |
| EUR | 194 175 000 | CHF | 189 373 441 | 03.08.2023 |
| USD | 448 690 000 | CHF | 403 079 764 | 03.08.2023 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 241 690 | 03.08.2023 |
| PLN | 8 550 000 | CHF | 1 870 206 | 03.08.2023 |
| AUD | 22 985 000 | CHF | 13 688 342 | 03.08.2023 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 346 861 | 03.08.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 097 573 | 03.08.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 718 682 | 03.08.2023 |
| SEK | 40 170 000 | CHF | 3 322 596 | 03.08.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 310 934 | 03.08.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 884 597 | 03.08.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 704 045 | 03.08.2023 |
| CAD | 35 155 000 | CHF | 23 848 024 | 03.08.2023 |
| KRW | 457 000 000 | USD | 349 809 | 03.08.2023 |
| JPY | 118 700 000 | CHF | 738 481 | 03.08.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| GBP | 725 000 | CHF | 824 310 | 03.08.2023 |
| EUR | 3 495 000 | CHF | 3 420 046 | 03.08.2023 |
| USD | 5 030 000 | CHF | 4 507 006 | 03.08.2023 |
| CHF | 514 092 | USD | 600 000 | 03.08.2023 |
| USD | 4 925 060 | IDR | 73 875 900 000 | 03.08.2023 |
| USD | 12 018 126 | KRW | 15 382 000 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 13 393 360 | AUD | 22 985 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 1 850 869 | DKK | 14 370 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 101 747 801 | JPY | 16 643 600 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 394 818 515 | USD | 453 501 625 | 03.08.2023 |
| CHF | 34 016 136 | GBP | 30 415 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 189 780 990 | EUR | 197 670 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 3 323 653 | SEK | 40 170 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 23 109 139 | CAD | 35 155 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 2 210 234 | SGD | 3 380 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 1 327 994 | NZD | 2 465 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 735 202 | NOK | 8 590 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 1 859 104 | PLN | 8 550 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 1 065 132 | ILS | 4 525 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 672 421 | HUF | 270 000 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 1 284 647 | CZK | 31 980 000 | 03.08.2023 |
| CHF | 181 700 | EUR | 190 000 | 29.08.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 920 140 | 05.09.2023 |
| KRW | 15 382 000 000 | USD | 12 038 631 | 05.09.2023 |
| AUD | 22 710 000 | CHF | 13 201 328 | 05.09.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 847 933 | 05.09.2023 |
| GBP | 30 700 000 | CHF | 34 218 159 | 05.09.2023 |
| USD | 454 055 000 | CHF | 393 899 977 | 05.09.2023 |
| EUR | 198 005 000 | CHF | 189 729 975 | 05.09.2023 |
| SEK | 40 170 000 | CHF | 3 317 203 | 05.09.2023 |
| CAD | 34 790 000 | CHF | 22 798 409 | 05.09.2023 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 205 878 | 05.09.2023 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 323 372 | 05.09.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 733 440 | 05.09.2023 |
| PLN | 9 280 000 | CHF | 2 007 261 | 05.09.2023 |
| JPY | 16 454 300 000 | CHF | 100 746 678 | 05.09.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 062 649 | 05.09.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 664 795 | 05.09.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 278 378 | 05.09.2023 |
| CAD | 695 000 | CHF | 456 974 | 05.09.2023 |
| KRW | 428 250 000 | USD | 333 337 | 05.09.2023 |
| JPY | 484 000 000 | CHF | 2 968 742 | 05.09.2023 |
| EUR | 4 700 000 | CHF | 4 507 421 | 05.09.2023 |
| GBP | 860 000 | CHF | 959 997 | 05.09.2023 |
| USD | 9 850 000 | CHF | 8 592 919 | 05.09.2023 |
| EUR | 300 000 | CHF | 287 555 | 05.09.2023 |
| EUR | 90 000 | CHF | 86 182 | 05.09.2023 |
| EUR | 190 000 | CHF | 181 626 | 05.09.2023 |
| JPY | 47 600 000 | CHF | 288 690 | 05.09.2023 |
| USD | 1 760 000 | CHF | 1 555 882 | 05.09.2023 |
| USD | 11 956 900 | KRW | 15 810 250 000 | 05.09.2023 |
| USD | 4 842 162 | IDR | 73 875 900 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 681 613 | HUF | 270 000 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 1 848 945 | DKK | 14 370 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 1 990 626 | PLN | 9 280 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 12 959 234 | AUD | 22 710 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 1 050 981 | ILS | 4 525 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 1 292 868 | NZD | 2 465 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 710 034 | NOK | 8 590 000 | 05.09.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| CHF | 1 272 228 | CZK | 31 980 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 3 241 367 | SEK | 40 170 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 102 646 241 | JPY | 16 985 900 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 35 290 392 | GBP | 31 560 000 | 05.09.2023 |
| CHF | 194 828 344 | EUR | 203 285 000 | 05.09.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 838 769 | 03.10.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 675 619 | 03.10.2023 |
| PLN | 9 280 000 | CHF | 1 981 372 | 03.10.2023 |
| CAD | 35 485 000 | CHF | 23 045 936 | 03.10.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 846 360 | 03.10.2023 |
| AUD | 22 710 000 | CHF | 12 933 288 | 03.10.2023 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 201 960 | 03.10.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 048 949 | 03.10.2023 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 289 029 | 03.10.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 708 512 | 03.10.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 266 960 | 03.10.2023 |
| SEK | 40 170 000 | CHF | 3 236 055 | 03.10.2023 |
| JPY | 16 747 700 000 | CHF | 101 353 175 | 03.10.2023 |
| GBP | 31 345 000 | CHF | 34 948 108 | 03.10.2023 |
| USD | 462 195 000 | CHF | 406 230 118 | 03.10.2023 |
| EUR | 202 955 000 | CHF | 194 180 241 | 03.10.2023 |
| CHF | 2 913 136 | USD | 3 310 000 | 03.10.2023 |
| USD | 4 796 825 | IDR | 73 875 900 000 | 03.10.2023 |
| CHF | 918 106 | USD | 1 000 000 | 03.10.2023 |
| KRW | 15 811 000 000 | USD | 11 977 395 | 04.10.2023 |
| USD | 11 808 066 | KRW | 15 811 000 000 | 04.10.2023 |
| KRW | 15 811 000 000 | USD | 11 757 139 | 04.10.2023 |
| USD | 11 757 139 | KRW | 15 811 000 000 | 04.10.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 794 054 | 02.11.2023 |
| KRW | 15 811 000 000 | USD | 11 824 226 | 02.11.2023 |
| SEK | 40 170 000 | CHF | 3 370 045 | 02.11.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 262 720 | 02.11.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 661 028 | 02.11.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 859 154 | 02.11.2023 |
| PLN | 9 280 000 | CHF | 1 926 789 | 02.11.2023 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 350 208 | 02.11.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 078 109 | 02.11.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 735 897 | 02.11.2023 |
| CAD | 34 465 000 | CHF | 23 310 230 | 02.11.2023 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 256 104 | 02.11.2023 |
| AUD | 22 710 000 | CHF | 13 393 586 | 02.11.2023 |
| GBP | 31 070 000 | CHF | 34 600 981 | 02.11.2023 |
| JPY | 16 647 500 000 | CHF | 101 930 542 | 02.11.2023 |
| EUR | 197 910 000 | CHF | 191 016 795 | 02.11.2023 |
| USD | 447 885 000 | CHF | 406 632 104 | 02.11.2023 |
| CHF | 1 220 434 | CAD | 1 820 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 5 669 066 | EUR | 5 890 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 4 261 191 | JPY | 696 100 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 8 340 725 | USD | 9 140 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 200 000 | GBP | 182 276 | 02.11.2023 |
| EUR | 110 000 | GBP | 95 179 | 02.11.2023 |
| CHF | 954 220 | AUD | 1 670 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 763 877 | GBP | 700 000 | 02.11.2023 |
| CHF | 624 613 | USD | 700 000 | 02.11.2023 |
| USD | 4 652 662 | IDR | 73 875 900 000 | 02.11.2023 |
| USD | 11 647 145 | KRW | 15 811 000 000 | 02.11.2023 |
| IDR | 73 875 900 000 | USD | 4 648 914 | 04.12.2023 |
| KRW | 15 811 000 000 | USD | 11 664 331 | 04.12.2023 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| JPY | 15 722 100 000 | CHF | 94 463 905 | 04.12.2023 |
| GBP | 30 095 000 | CHF | 32 973 135 | 04.12.2023 |
| USD | 431 255 000 | CHF | 387 803 902 | 04.12.2023 |
| EUR | 194 405 000 | CHF | 186 197 221 | 04.12.2023 |
| SEK | 40 170 000 | CHF | 3 255 773 | 04.12.2023 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 246 321 | 04.12.2023 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 672 703 | 04.12.2023 |
| CAD | 32 995 000 | CHF | 21 479 491 | 04.12.2023 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 846 494 | 04.12.2023 |
| AUD | 20 510 000 | CHF | 11 754 414 | 04.12.2023 |
| PLN | 9 280 000 | CHF | 1 998 920 | 04.12.2023 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 228 740 | 04.12.2023 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 013 980 | 04.12.2023 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 296 634 | 04.12.2023 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 694 867 | 04.12.2023 |
| USD | 340 000 | KRW | 457 461 738 | 04.12.2023 |
| CHF | 306 165 | USD | 340 000 | 04.12.2023 |
| USD | 2 640 000 | CHF | 2 392 885 | 04.12.2023 |
| EUR | 1 130 000 | CHF | 1 079 503 | 04.12.2023 |
| CAD | 785 000 | CHF | 512 770 | 04.12.2023 |
| JPY | 267 700 000 | CHF | 1 610 320 | 04.12.2023 |
| CHF | 805 838 | EUR | 840 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 1 629 433 | USD | 1 815 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 579 014 | JPY | 97 000 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 343 147 | EUR | 355 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 3 340 893 | USD | 3 780 000 | 04.12.2023 |
| CHF | 584 500 | JPY | 98 000 000 | 04.12.2023 |
| CAD | 3 690 000 | CHF | 2 373 183 | 04.12.2023 |
| JPY | 1 880 000 000 | CHF | 11 142 332 | 04.12.2023 |
| AUD | 2 600 000 | CHF | 1 505 507 | 04.12.2023 |
| EUR | 20 245 000 | CHF | 19 490 449 | 04.12.2023 |
| GBP | 3 500 000 | CHF | 3 868 970 | 04.12.2023 |
| USD | 46 000 000 | CHF | 40 620 121 | 04.12.2023 |
| IDR | 10 545 000 000 | USD | 675 555 | 04.12.2023 |
| KRW | 1 461 800 000 | USD | 1 122 863 | 04.12.2023 |
| EUR | 205 000 | CHF | 197 595 | 04.12.2023 |
| USD | 545 000 | CHF | 481 406 | 04.12.2023 |
| USD | 5 458 765 | IDR | 84 420 900 000 | 04.12.2023 |
| USD | 12 942 143 | KRW | 16 815 338 262 | 04.12.2023 |
| EUR | 95 000 | CHF | 91 510 | 04.12.2023 |
| USD | 245 000 | CHF | 215 812 | 04.12.2023 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 458 236 | 03.01.2024 |
| KRW | 16 816 000 000 | USD | 12 965 005 | 03.01.2024 |
| SEK | 42 220 000 | CHF | 3 526 940 | 03.01.2024 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 249 710 | 03.01.2024 |
| CAD | 38 935 000 | CHF | 24 954 181 | 03.01.2024 |
| HUF | 270 000 000 | CHF | 673 856 | 03.01.2024 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 838 096 | 03.01.2024 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 208 024 | 03.01.2024 |
| PLN | 9 280 000 | CHF | 2 026 085 | 03.01.2024 |
| AUD | 23 710 000 | CHF | 13 664 806 | 03.01.2024 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 320 546 | 03.01.2024 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 699 932 | 03.01.2024 |
| ILS | 4 525 000 | CHF | 1 065 671 | 03.01.2024 |
| USD | 496 900 000 | CHF | 433 181 519 | 03.01.2024 |
| GBP | 34 850 000 | CHF | 38 418 292 | 03.01.2024 |
| EUR | 221 060 000 | CHF | 210 665 759 | 03.01.2024 |
| USD | 590 173 | KRW | 765 000 000 | 03.01.2024 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| CHF | 520 000 | USD | 596 744 | 03.01.2024 |
| PLN | 1 400 000 | CHF | 305 760 | 03.01.2024 |
| SEK | 4 150 000 | CHF | 347 014 | 03.01.2024 |
| CAD | 405 000 | CHF | 261 837 | 03.01.2024 |
| USD | 7 755 000 | CHF | 6 775 016 | 03.01.2024 |
| EUR | 4 455 000 | CHF | 4 234 019 | 03.01.2024 |
| GBP | 620 000 | CHF | 684 002 | 03.01.2024 |
| KRW | 687 260 000 | USD | 526 678 | 03.01.2024 |
| ILS | 1 015 000 | CHF | 237 842 | 03.01.2024 |
| EUR | 160 000 | CHF | 151 020 | 03.01.2024 |
| USD | 12 935 286 | KRW | 16 738 260 000 | 03.01.2024 |
| USD | 5 494 721 | IDR | 84 420 900 000 | 03.01.2024 |
| USD | 13 041 725 | KRW | 16 816 000 000 | 03.01.2024 |
| KRW | 765 000 000 | USD | 593 299 | 03.01.2024 |
| USD | 533 008 | KRW | 687 260 000 | 03.01.2024 |
| KRW | 16 738 260 000 | USD | 12 981 433 | 03.01.2024 |
| CHF | 3 903 416 | SEK | 46 370 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 1 205 064 | CZK | 31 980 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 1 793 665 | DKK | 14 370 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 24 899 073 | CAD | 39 340 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 656 869 | HUF | 270 000 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 2 292 564 | PLN | 10 680 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 2 147 518 | SGD | 3 380 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 13 559 038 | AUD | 23 710 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 1 279 623 | ILS | 5 540 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 710 383 | NOK | 8 590 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 37 967 088 | GBP | 35 470 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 209 891 291 | EUR | 225 675 000 | 03.01.2024 |
| CHF | 421 880 959 | USD | 504 159 846 | 03.01.2024 |
| USD | 5 468 029 | IDR | 84 420 900 000 | 03.01.2024 |
| JPY | 17 957 200 000 | CHF | 106 633 698 | 04.01.2024 |
| JPY | 314 300 000 | CHF | 1 872 227 | 04.01.2024 |
| KRW | 16 739 000 000 | USD | 12 955 882 | 02.02.2024 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 494 364 | 02.02.2024 |
| SEK | 46 370 000 | CHF | 3 895 905 | 02.02.2024 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 200 137 | 02.02.2024 |
| DKK | 14 370 000 | CHF | 1 790 769 | 02.02.2024 |
| CAD | 40 730 000 | CHF | 25 709 330 | 02.02.2024 |
| HUF | 342 400 000 | CHF | 827 004 | 02.02.2024 |
| PLN | 10 680 000 | CHF | 2 284 629 | 02.02.2024 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 143 712 | 02.02.2024 |
| AUD | 24 325 000 | CHF | 13 880 490 | 02.02.2024 |
| NZD | 2 465 000 | CHF | 1 303 039 | 02.02.2024 |
| ILS | 5 540 000 | CHF | 1 276 380 | 02.02.2024 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 708 714 | 02.02.2024 |
| GBP | 37 435 000 | CHF | 39 950 557 | 02.02.2024 |
| USD | 522 085 000 | CHF | 435 512 343 | 02.02.2024 |
| JPY | 18 376 200 000 | CHF | 109 417 638 | 02.02.2024 |
| EUR | 234 535 000 | CHF | 217 703 127 | 02.02.2024 |
| DKK | 3 190 000 | CHF | 396 041 | 02.02.2024 |
| USD | 1 320 000 | CHF | 1 101 356 | 02.02.2024 |
| EUR | 4 560 000 | CHF | 4 217 790 | 02.02.2024 |
| GBP | 1 155 000 | CHF | 1 228 153 | 02.02.2024 |
| JPY | 291 500 000 | CHF | 1 744 866 | 02.02.2024 |
| USD | 11 210 000 | CHF | 9 497 852 | 02.02.2024 |
| AUD | 465 000 | CHF | 267 373 | 02.02.2024 |
| EUR | 310 000 | CHF | 287 832 | 02.02.2024 |
| CAD | 1 940 000 | CHF | 1 235 140 | 02.02.2024 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|--------------------|-------------------|-----------------|----------------|------------|
| EUR | 1 075 000 | CHF | 999 845 | 02.02.2024 |
| GBP | 70 000 | CHF | 75 358 | 02.02.2024 |
| USD | 440 000 | CHF | 374 132 | 02.02.2024 |
| EUR | 340 000 | CHF | 316 076 | 02.02.2024 |
| USD | 400 000 | CHF | 339 698 | 02.02.2024 |
| NZD | 275 000 | CHF | 145 938 | 02.02.2024 |
| USD | 210 000 | CHF | 178 189 | 02.02.2024 |
| USD | 100 000 | CHF | 86 583 | 02.02.2024 |
| USD | 5 360 057 | IDR | 84 420 900 000 | 02.02.2024 |
| USD | 12 548 917 | KRW | 16 739 000 000 | 02.02.2024 |
| JPY | 149 000 000 | CHF | 871 950 | 02.02.2024 |
| USD | 5 000 000 | CHF | 4 314 685 | 02.02.2024 |
| EUR | 600 000 | CHF | 561 538 | 02.02.2024 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 354 957 | 04.03.2024 |
| KRW | 16 739 000 000 | USD | 12 569 082 | 04.03.2024 |
| KRW | 887 200 000 | USD | 667 969 | 04.03.2024 |
| SEK | 46 370 000 | CHF | 3 834 443 | 04.03.2024 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 199 872 | 04.03.2024 |
| HUF | 342 400 000 | CHF | 825 809 | 04.03.2024 |
| CAD | 41 700 000 | CHF | 26 734 466 | 04.03.2024 |
| DKK | 17 560 000 | CHF | 2 198 543 | 04.03.2024 |
| PLN | 10 680 000 | CHF | 2 293 505 | 04.03.2024 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 173 764 | 04.03.2024 |
| AUD | 24 790 000 | CHF | 14 046 631 | 04.03.2024 |
| ILS | 5 540 000 | CHF | 1 311 069 | 04.03.2024 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 705 731 | 04.03.2024 |
| NZD | 2 740 000 | CHF | 1 443 456 | 04.03.2024 |
| JPY | 18 663 200 000 | CHF | 109 273 799 | 04.03.2024 |
| EUR | 237 300 000 | CHF | 221 487 040 | 04.03.2024 |
| USD | 535 065 000 | CHF | 460 205 126 | 04.03.2024 |
| GBP | 37 350 000 | CHF | 40 765 284 | 04.03.2024 |
| EUR | 790 000 | CHF | 735 562 | 04.03.2024 |
| CHF | 3 182 093 | USD | 3 700 000 | 04.03.2024 |
| EUR | 200 000 | CHF | 188 622 | 04.03.2024 |
| EUR | 140 000 | CHF | 132 614 | 04.03.2024 |
| EUR | 375 000 | GBP | 320 052 | 04.03.2024 |
| USD | 5 396 031 | IDR | 84 420 900 000 | 04.03.2024 |
| USD | 13 243 820 | KRW | 17 626 200 000 | 04.03.2024 |
| USD | 12 547 976 | KRW | 16 739 000 000 | 04.03.2024 |
| USD | 665 067 | KRW | 887 200 000 | 04.03.2024 |
| KRW | 17 626 200 000 | USD | 13 213 043 | 04.03.2024 |
| CHF | 451 115 | USD | 500 000 | 02.04.2024 |
| KRW | 17 627 000 000 | USD | 13 264 005 | 03.04.2024 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 390 346 | 03.04.2024 |
| SEK | 46 370 000 | CHF | 3 939 802 | 03.04.2024 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 198 012 | 03.04.2024 |
| CAD | 41 700 000 | CHF | 26 919 456 | 03.04.2024 |
| HUF | 342 400 000 | CHF | 826 590 | 03.04.2024 |
| PLN | 10 680 000 | CHF | 2 349 712 | 03.04.2024 |
| DKK | 17 560 000 | CHF | 2 244 406 | 03.04.2024 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 207 349 | 03.04.2024 |
| AUD | 24 790 000 | CHF | 14 140 900 | 03.04.2024 |
| ILS | 5 540 000 | CHF | 1 357 675 | 03.04.2024 |
| NZD | 2 740 000 | CHF | 1 462 225 | 03.04.2024 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 710 488 | 03.04.2024 |
| GBP | 36 710 000 | CHF | 40 758 929 | 03.04.2024 |
| JPY | 18 738 700 000 | CHF | 110 057 640 | 03.04.2024 |
| USD | 526 055 000 | CHF | 461 285 004 | 03.04.2024 |

| Verkauf Währung | Verkauf Betrag | Kauf Währung | Kauf Betrag | Fälligkeit |
|----------------------------|---------------------------|-------------------------|------------------------|-------------------|
| EUR | 237 165 000 | CHF | 225 771 831 | 03.04.2024 |
| CHF | 2 000 595 | JPY | 339 400 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 1 922 456 | EUR | 2 010 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 4 282 948 | USD | 4 850 000 | 03.04.2024 |
| USD | 200 000 | CHF | 176 193 | 03.04.2024 |
| EUR | 185 000 | CHF | 178 669 | 03.04.2024 |
| EUR | 370 000 | CHF | 359 680 | 03.04.2024 |
| USD | 5 341 743 | IDR | 84 420 900 000 | 03.04.2024 |
| USD | 13 059 939 | KRW | 17 627 000 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 27 763 860 | CAD | 41 700 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 846 107 | HUF | 342 400 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 1 363 256 | ILS | 5 540 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 2 416 705 | PLN | 10 680 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 2 265 613 | SGD | 3 380 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 110 079 871 | JPY | 18 399 300 000 | 03.04.2024 |
| CHF | 471 819 072 | USD | 521 203 062 | 03.04.2024 |
| IDR | 84 420 900 000 | USD | 5 336 677 | 03.05.2024 |
| KRW | 17 627 000 000 | USD | 13 078 835 | 03.05.2024 |
| CZK | 31 980 000 | CHF | 1 229 515 | 03.05.2024 |
| CAD | 41 975 000 | CHF | 27 866 191 | 03.05.2024 |
| AUD | 25 100 000 | CHF | 14 714 938 | 03.05.2024 |
| DKK | 17 560 000 | CHF | 2 295 625 | 03.05.2024 |
| HUF | 342 400 000 | CHF | 841 533 | 03.05.2024 |
| SEK | 46 370 000 | CHF | 3 922 281 | 03.05.2024 |
| SGD | 3 380 000 | CHF | 2 261 227 | 03.05.2024 |
| NOK | 8 590 000 | CHF | 716 092 | 03.05.2024 |
| NZD | 2 740 000 | CHF | 1 474 651 | 03.05.2024 |
| EUR | 239 085 000 | CHF | 233 064 122 | 03.05.2024 |
| GBP | 37 530 000 | CHF | 42 723 026 | 03.05.2024 |
| USD | 526 540 000 | CHF | 475 062 817 | 03.05.2024 |
| USD | 500 000 | CHF | 449 566 | 03.05.2024 |
| EUR | 1 300 000 | CHF | 1 264 632 | 03.05.2024 |
| ILS | 5 540 000 | CHF | 1 359 973 | 06.05.2024 |
| PLN | 10 680 000 | CHF | 2 407 148 | 06.05.2024 |
| JPY | 18 338 500 000 | CHF | 109 867 956 | 07.05.2024 |

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

| Position | Betrag in CHF | in % des Nettofonds- vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Brutto Gesamtengagement aus Derivaten | 954 130 458,68 | 105,04 |
| Netto Gesamtengagement aus Derivaten | – | – |
| Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften | – | – |

Effektenleihe

Das Teilvermögen darf keine Effektenleihe tätigen.

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Siehe separate Aufstellung am Ende des Berichtes.

Soft Commission Arrangements

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

Total Expense Ratio (TER)

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

TER für die letzten 12 Monate:

UBS (CH) Institutional Fund 3

– Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II

Klasse I-X

0,01%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

| | |
|------------------|------------------|
| AUD 1 = CHF 0.59 | JPY 1 = CHF 0.01 |
| CAD 1 = CHF 0.67 | KRW 1 = CHF 0.00 |
| CZK 1 = CHF 0.04 | MYR 1 = CHF 0.19 |
| DKK 1 = CHF 0.13 | NOK 1 = CHF 0.08 |
| EUR 1 = CHF 0.97 | NZD 1 = CHF 0.54 |
| GBP 1 = CHF 1.14 | PLN 1 = CHF 0.23 |
| HUF 1 = CHF 0.00 | SEK 1 = CHF 0.08 |
| IDR 1 = CHF 0.00 | SGD 1 = CHF 0.67 |
| ILS 1 = CHF 0.25 | USD 1 = CHF 0.90 |

Anhang zu Ergänzende Angaben

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Grundsätze der Bewertung

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens (Teilvermögen, für die gemäss § 17 Fondsvertrag Teil II kein Single Swinging Pricing festgelegt ist) und der Bewertungs-Nettoinventarwert (Teilvermögen, für die gemäss § 17 Fondsvertrag Teil II Single Swinging Pricing festgelegt ist) und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des entsprechenden Teilvermögens statt. Die Fondsleitung kann jedoch auch an Tagen, an welchen keine Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, den Nettoinventarwert eines Anteils («nicht handelbarer Nettoinventarwert») berechnen, z.B. wenn der letzte Kalendertag eines Monats auf einen in Ziff. 6.2.1 Bst. a des Anhangs des Fondsvertrags genannten Tag fällt. Solche nicht handelbare Nettoinventarwerte können veröffentlicht werden, dürfen aber nur für Performance-Berechnungen und -Statistiken (insbesondere zwecks Vergleich mit dem Referenzindex) oder für Kommissionsberechnungen, auf keinen Fall aber als Basis für Zeichnungs- und Rücknahmeaufträge verwendet werden.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen basiert auf der jeweils relevanten Zinskurve. Die auf der Zinskurve basierende Bewertung bezieht sich auf die Komponenten Zinssatz und Spread. Dabei werden folgende Grundsätze angewandt: Für jedes Geldmarktinstrument werden die der Restlaufzeit nächsten Zinssätze intrapoliert. Der dadurch ermittelte Zinssatz wird unter Zuzug eines Spreads, welcher die Bonität des zugrundeliegenden Schuldners wiedergibt, in einen Marktkurs konvertiert. Dieser Spread wird bei signifikanter Änderung der Bonität des Schuldners angepasst.

5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Derivative Finanzinstrumente, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Derivative Finanzinstrumente, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden (OTC-Derivate), sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.

Grundsätze der Nettoinventarwertberechnung

Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die kleinste Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gerundet.

Vergütung an die Fondsleitung

Effektiv erhobene Verwaltungskommission:

| Teilvermögen UBS (CH) Institutional Fund 3 | Anteil- klasse | Rechnungs- währung | Kommission b.p. p.a. |
|--|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II | | | |
| | I-A1 | CHF | 18 |
| | I-A2 | CHF | 18 |
| | I-A3 | CHF | 16 |
| | I-B | CHF | 5,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 18 |
| – CHF Exposure | | | |
| | I-A1 | CHF | 105,5 |
| | I-A2 | CHF | 0 |
| | I-A3 | CHF | 0 |
| | I-B | CHF | 5,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 117 |
| – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II | | | |
| | I-A1 | CHF | 62 |
| | I-A2 | CHF | 52 |
| | I-A3 | CHF | 38 |
| | I-B | CHF | 4,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 62 |
| – Bonds CHF Inland Government Passive II | | | |
| | I-A1 | CHF | 18 |
| | I-A2 | CHF | 18 |
| | I-A3 | CHF | 14 |
| | I-B | CHF | 3,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 18 |
| – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II | | | |
| | I-A1 | CHF | 30 |
| | I-A2 | CHF | 30 |
| | I-A3 | CHF | 25 |
| | I-B | CHF | 5,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 30 |
| – Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II | | | |
| | I-A1 | CHF | 30 |
| | I-A2 | CHF | 30 |
| | I-A3 | CHF | 25 |
| | I-B | CHF | 5,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 30 |
| – Equities Switzerland II | | | |
| | I-A1 | CHF | 41 |
| | I-A2 | CHF | 36 |
| | I-A3 | CHF | 32 |
| | I-B | CHF | 5,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 46 |
| – Bonds CHF Short Term II | | | |
| | I-A1 | CHF | 21 |
| | I-A2 | CHF | 18 |
| | I-A3 | CHF | 15 |
| | I-B | CHF | 3,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 24 |

| Teilvermögen UBS (CH) Institutional Fund 3 | Anteil- klasse | Rechnungs- währung | Kommission b.p. p.a. |
|--|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II | | | |
| | I-A1 | CHF | 18 |
| | I-A2 | CHF | 18 |
| | I-A3 | CHF | 14 |
| | I-B | CHF | 4,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 18 |
| – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II | | | |
| | I-A1 | CHF | 18 |
| | I-A2 | CHF | 18 |
| | I-A3 | CHF | 14 |
| | I-B | CHF | 4,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 18 |
| – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II | | | |
| | I-A1 | CHF | 24 |
| | I-A2 | CHF | 24 |
| | I-A3 | CHF | 17 |
| | I-B | CHF | 4,5 |
| | I-X | CHF | 0 |
| | U-X | CHF | 0 |
| | Q | CHF | 24 |

Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag p.a.:

a) Anteilklasse «I-A1», «I-A2» und «I-A3»

Für die Anteilklassen gilt eine Kommission von maximal 1,300% p.a.

b) Anteilklasse «I-B»

Für die Anteilklasse gilt eine Kommission von maximal 0,200% p.a.

Zusätzlich werden die durch den Anleger zu tragenden Kosten für die Vermögensverwaltung und den Vertrieb über eine von (maximal 1,3% des Nettoinventarwertes) UBS mit dem Anleger individuell ausgehandelte schriftliche Vereinbarung entschädigt.

c) Anteilklasse «I-X»

0,000% p.a.

Die durch den Anleger zu tragenden Kosten im Zusammenhang mit den für die Anteilklasse «I-X» zu erbringenden Leistungen werden über eine von UBS mit dem Anleger individuell ausgehandelte schriftliche Vereinbarung entschädigt (maximal 1,3% des Nettoinventarwertes).

d) Anteilklasse «U-X»

0,000% p.a.

Die durch den Anleger zu tragenden Kosten im Zusammenhang mit den für die Anteilklasse «U-X» zu erbringenden Leistungen werden über eine von UBS mit dem Anleger individuell ausgehandelte schriftliche Vereinbarung entschädigt (maximal 1,3% des Nettoinventarwertes).

Nicht in der pauschalen Verwaltungskommission bzw. Kommission enthalten sind die folgenden Vergütungen und Nebenkosten der Fondsleitung und der Depotbank, welche zusätzlich dem Fondsvermögen belastet werden:

– Kosten für den An- und Verkauf der Anlagen, namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben. In Abweichung hiervon sind diese Nebenkosten, die durch An- und Verkauf von Anlagen bei der Abwicklung von Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen,

durch die Anwendung des Swinging Single Pricing gemäss § 16 Ziff. 7 gedeckt. Vorbehalten bleibt § 17 Fondsvertrag Teil II;

- Abgaben der Aufsichtsbehörde für die Gründung, Änderung, Auflösung oder Vereinigung des Umbrella-Fonds bzw. der jeweiligen Teilvermögen;
- Jahresgebühr der Aufsichtsbehörde;
- Honorare der Prüfgesellschaft für die jährliche Prüfung sowie für Bescheinigungen im Rahmen der Gründung, Änderungen, Auflösung oder Vereinigungen des Umbrella-Fonds bzw. der jeweiligen Teilvermögen;
- Honorare für Rechts- und Steuerberater im Zusammenhang mit der Gründung, Änderungen, Auflösung oder Vereinigung des Anlagefonds sowie der allgemeinen Wahrnehmung der Interessen des Umbrella-Fonds bzw. der jeweiligen Teilvermögen und seiner Anleger;
- Kosten für den Druck juristischer Dokumente sowie Druck der Jahresberichte des Umbrella-Fonds bzw. der jeweiligen Teilvermögen;
- Kosten für die Publikation des Nettoinventarwertes der jeweiligen Teilvermögen sowie sämtliche Kosten für die Mitteilungen an die Anleger einschliesslich Übersetzungskosten, welche nicht einem Fehlverhalten der Fondsleitung zuzuschreiben sind;
- Kosten für die Übersetzung der Fondsverträge mit Anhang sowie der Jahresberichte;
- Kosten für eine allfällige Eintragung des Umbrella-Fonds bzw. der jeweiligen Teilvermögen bei einer ausländischen Aufsichtsbehörde, namentlich von der ausländischen Aufsichtsbehörde erhobene Kommissionen, Übersetzungskosten sowie die Entschädigung des Vertreters oder der Zahlstelle im Ausland;
- Kosten im Zusammenhang mit der Ausübung von Stimmrechten oder Gläubigerrechten durch den Umbrella-Fonds bzw. das jeweilige Teilvermögen, einschliesslich der Honorarkosten für externe Beraterinnen und Berater;
- Kosten und Honorare im Zusammenhang mit im Namen des Umbrella-Fonds bzw. der jeweiligen Teilvermögen eingetragenen geistigen Eigentum oder mit Nutzungsrechten des Fonds;
- Alle Kosten, die durch die Ergreifung ausserordentlicher Schritte zur Wahrung der Interessen der Anlegerinteressen durch die Fondsleitung, den Vermögensverwalter kollektiver Kapitalanlagen oder die Depotbank verursacht werden;
- Bei Teilnahme an Sammelklagen im Interesse der Anleger darf die Fondsleitung die daraus entstandenen Kosten Dritter (z.B. Anwalts- und Depotbankkosten) dem Fondsvermögen belasten. Zusätzlich kann die Fondsleitung sämtliche administrativen Aufwände belasten, sofern diese nachweisbar sind und im Rahmen der Offenlegung der TER des Fonds ausgewiesen resp. berücksichtigt werden.
- Lizenzgebühren für Index-Gebrauch

Die Fondsleitung und deren Beauftragte können gemäss den Bestimmungen im Anhang Retrozessionen zur Entschädigung der Vertriebstätigkeit von Fondsanteilen bezahlen und Rabatte gewähren, um die auf den Anleger entfallenden, dem Umbrella-Fonds bzw. den Teilvermögen belasteten Gebühren und Kosten zu reduzieren oder die Gebühren in Vereinbarungen mit dem Anleger individuell festlegen.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 3% betragen. Im Jahresbericht ist der maximale Satz der Verwaltungskommissionen der Zielfonds, in die investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten je Teilvermögen anzugeben.

Erwirbt die Fondsleitung Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist («verbundene Zielfonds»), so darf sie allfällige Ausgabe- oder Rücknahmekommissionen der verbundenen Zielfonds nicht den Teilvermögen belasten.

Retrozessionen und andere Vermögensvorteile

Retrozessionen und andere Vermögensvorteile sind gem. Art. 21 Kollektivanlagengesetz der kollektiven Kapitalanlage gutzuschreiben. Die Fondsleitung hat für die Teilvermögen von UBS (CH) Institutional Fund 3 keine Retrozessionen und Rückvergütungen bzw. Rabatte ausgerichtet. Allfällig erhaltene Retrozessionen und Rabatte wurden den betreffenden Teilvermögen ausgerichtet.

Maximale Verwaltungskommissionssätze für die im Fondsvermögen enthaltenen Zielfonds

Zielfonds

| | |
|--|-------|
| BALOISE SWISS PROPERTY FUND-DISTRIBUTIVE | 1,00% |
| BONHOTE-IMMOBILIER SICAV - BIM | 0,75% |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY - A | 1,00% |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY - A | 1,00% |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND INTERSWISS - A | 0,70% |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVING PLUS | 1,00% |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICS PLUS | 1,00% |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND SIAT - A | 0,70% |
| CRONOS IMMO FUND | 1,00% |
| DOMINICE SWISS PROPERTY FUND | 1,20% |
| EDMOND DE ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV - SWISS - A-CHF | 0,77% |
| FIR FONDS IMMOBILIER ROMAND | 1,00% |
| GOOD BUILDINGS SWISS REAL ESTATE FUND | 0,60% |
| HELVETICA SWISS COMMERCIAL FUND | 1,00% |
| IMMO HELVETIC - A | 0,25% |
| IMMOFONDS SCHWEIZ IMMOBILIEN - ANLAGEFONDS | 0,90% |
| LA FONCIERE FONDS SUISSE DE PLACEMENTS IMMOBILIERS | 0,50% |
| PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND - A | 1,05% |
| PROCIMMO REAL ESTATE SICAV | 1,50% |
| PROCIMMO RESIDENTIAL LEMANIC FUND | 1,20% |
| PROCIMMO SWISS COMMERCIAL FUND II - C | 1,50% |
| REALSTONE SWISS PROPERTY (RSP) - UT | 1,00% |
| RESIDENTIA | 1,00% |
| SCHRODER IMMO PLUS | 1,00% |
| SF COMMERCIAL PROPERTIES FUND | 1,00% |
| SF RETAIL PROPERTIES FUND | 1,00% |
| SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND | 1,00% |
| SOLVALOR 61 FONDS DE PLACEMENT IMMOBILIER | 1,00% |
| STREETBOX REAL ESTATE FUND | 1,50% |
| SUISSE ROMANDE PROPERTY FUND | 1,00% |
| SWISS CENTRAL CITY REAL ESTATE FUND-CHF | 1,50% |
| SWISS LIFE REF (CH) SWISS PROPERTIES | 1,00% |
| SWISSCANTO (CH) REAL ESTATE FUND RESPONSIBLE IFCA - FA CHF | 0,60% |
| SWISSCANTO (CH) REAL ESTATE FUND RESPONSIBLE SWISS COMMERCIAL - FA CHF | 0,80% |
| SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT FUND | 0,70% |
| UBS (CH) INSTITUTIONAL FUND - BONDS CHF INLAND - U-X | 0,00% |
| UBS (CH) INSTITUTIONAL FUND 3 - BONDS CHF INLAND II - U-X | 0,00% |
| UBS (CH) MONEY MARKET FUND - CHF - I-X | 0,00% |
| UBS (CH) PROPERTY FUND - DIRECT RESIDENTIAL | 1,00% |
| UBS (CH) PROPERTY FUND - DIRECT URBAN | 1,00% |
| UBS (CH) PROPERTY FUND - LEMAN RESIDENTIAL 'FONCIPARS' | 1,00% |
| UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS COMMERCIAL 'SWISSREAL' | 1,00% |
| UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED 'SIMA' | 1,00% |
| UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS RESIDENTIAL 'ANFOS' | 1,00% |

(OTC-)Derivate

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

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

| Stichtag: 31.3.2024 | UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II | UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II | UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II | UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II |
|--|---|---|---|--|
| Währung: | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate | | | | |
| R&S Group Holding AG | - | - | - | 3 239.64 |
| UBS AG | 3 036 422.15 | -17 733 310.32 | -3 919 319.47 | - |
| Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten: | | | | |
| – Anleihen | - | - | - | - |
| – Aktien | - | - | - | - |
| – Barmittel | 1 620 000.00 | - | - | - |
| – Anlagefonds | - | - | - | - |
| – Geldmarktanlagen | - | - | - | - |
| – Übrige Sicherheiten | - | - | - | - |
| Total entgegengenommenen Sicherheiten | 1 620 000.00 | - | - | - |

| Stichtag: 31.3.2024 | UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Short Term II | UBS (CH) Institutional Fund 3 – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II |
|--|--|--|
| Währung: | CHF | CHF |
| Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate | | |
| R&S Group Holding AG | - | - |
| UBS AG | 671 438.00 | -19 511 150.75 |
| Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten: | | |
| – Anleihen | - | - |
| – Aktien | - | - |
| – Barmittel | 755 000.00 | - |
| – Anlagefonds | - | - |
| – Geldmarktanlagen | - | - |
| – Übrige Sicherheiten | - | - |
| Total entgegengenommenen Sicherheiten | 755 000.00 | - |

Basel, 11. Juli 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

UBS (CH) Institutional Fund 3, Basel

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

UBS (CH) Institutional Fund 3

mit den Teilvermögen

- ▶ Swiss Real Estate Securities Selection Passive II
- ▶ CHF Exposure
- ▶ Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II
- ▶ Bonds CHF Inland Government Passive II
- ▶ Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II
- ▶ Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II
- ▶ Equities Swizterland II
- ▶ Bonds CHF Short Term II
- ▶ Bonds CHF Inland Medium Term Passive II
- ▶ Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II
- ▶ Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II

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

Nach unserer Beurteilung entsprechen die Jahresrechnungen (Seiten 2 bis 187) dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag.



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die in einem Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnungen und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zu den Jahresrechnungen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zu den Jahresrechnungen oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Zugelassener Revisionsexperte

Fakten und Konditionen (ungeprüft)

Stand per 31. März 2024

Alle Angaben können jederzeit ohne Vorankündigung geändert werden.

Legende und Erläuterungen zu den Tabellen auf den nächsten Seiten

Klassen

| Name | Erforderliches Anlagevolumen pro Teilvermögen und Anleger |
|------|---|
| I-A1 | ≤ 10 Mio. CHF |
| I-A2 | ≥ 10 Mio. CHF bis ≤ 30 Mio. CHF |
| I-A3 | > 30 Mio. CHF |

Pauschalpreise

Die Pauschale Verwaltungskommission deckt grundsätzlich alle Leistungen im Zusammenhang mit Vermögensverwaltung, Vertrieb und Fondsadministration (bestehend aus Fondsleitung, Administration und Depotbank) ab, mit Ausnahme der folgenden Kosten, die den Teilvermögen zusätzlich belastet werden: TTC (Transaction and Tax Costs) und Andere Kosten.

Andere Kosten

Kosten, welche den Teilvermögen direkt belastet werden (z.B. Revisionskosten, Aufsichtsgebühr, Lizenzgebühren).

TER Zielfonds

Total Expense Ratio (TER) der unterliegenden Zielfonds gemäss Definition AMAS.

Z / R - Methode

Angewendete Methode bei Zeichnungen und Rückgaben von Anteilen der Teilvermögen

- 1) NAV
Ausgabepreis = Rücknahmepreis = NAV (NAV = Net Asset Value = Nettoinventarwert)
- 2) VWS = Verwässerungsschutz
 - Ausgabepreis = NAV plus Verwässerungsschutz
 - Rücknahmepreis = NAV minus Verwässerungsschutz
 - Die Differenz zum NAV (= Verwässerungsschutz) fällt immer vollumfänglich zugunsten der Anlagegruppen, d. h. zugunsten der Performance für die Anleger an.
- 3) SSP (Swinging Single Pricing)
 - Ausgabepreis = Rücknahmepreis = NAV plus Swing-Faktor, falls am Handelstag Netto-Zeichnungen vorliegen
 - Ausgabepreis = Rücknahmepreis = NAV minus Swing-Faktor, falls am Handelstag Netto-Rückgaben vorliegen
 - Die Differenz zum NAV fällt immer vollumfänglich zugunsten des Teilvermögens, d.h. zugunsten der Performance für die Anleger an.
 - Die Swing-Faktoren richten sich nach den Courtagen von Dritt-Brokern, den Steuern und Abgaben sowie den geschätzten Differenzen zwischen den Geld- und Briefkursen der Transaktionen, die Zeichnungen oder Rücknahmen nach sich ziehen. Ein mit Finanzexperten besetzter UBS-Ausschuss beobachtet den Markt laufend und nimmt nötigenfalls Anpassungen der Swing-Faktoren vor.

Z / R - Ansatz in Basispunkten

Differenz zwischen Ausgabe- (= Zeichnungs-) preis resp. Rücknahmepreis zum NAV in Basispunkten des NAV (Ansatz des Verwässerungsschutz resp. Swing-Faktor)

Cut-off time

Zeitpunkt des Zeichnungs- und des Rücknahmeschlusses von Anteilsscheinen

Forward Pricing Methode

| | Forward Pricing 1 (FP 1) | | Forward Pricing 2 (FP 2) | |
|--------------------------------|--------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| Auftragserfassung | Tag X | (z.B. Montag) | Tag X | (z.B. Montag) |
| Börsenschlusskurse | Tag X | (Montag) | Tag X + 1 | (Dienstag) |
| Preisberechnung und Abrechnung | Tag X + 1 | (Dienstag) | Tag X + 2 | (Mittwoch) |
| Valuta | Tag X + 3 | (Donnerstag) | Tag X + 4 | (Freitag) |

| Klasse | ISIN | Pauschale Verwaltungs- kommission in % p.a. | Andere Kosten in % p.a. | TER Zielfonds in % p.a. | geprüfte TER in % p.a. | Z / R - Methode | Z / R - Ansatz in Basispunkten | Cut-off time | Forward Pricing Methode |
|---|--------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------------|--------------------|--------------------------------------|-----------------|-------------------------------|
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II | | | | | | | | | |
| Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad (TR) | | | | | | | | | |
| I-A1 | CH0042114261 | 0.1800 | 0.01 | 0.72 ^{1),(2)} | 0.91 | VWS | 5 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-A2 | CH0257359726 | 0.1800 | 0.01 | 0.72 ^{1),(2)} | 0.91 | VWS | 5 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-A3 | CH0487119098 | 0.1600 | 0.01 | 0.72 ^{1),(2)} | 0.89 | VWS | 5 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-B | CH0042114337 | 0.0550 | 0.00 | 0.72 ^{1),(2)} | 0.78 | VWS | 5 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-X | CH0042114378 | 0.0000 | 0.01 | 0.72 ^{1),(2)} | 0.73 | VWS | 5 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – CHF Exposure | | | | | | | | | |
| Benchmark: SBI® Domestic AAA-BBB (TR) | | | | | | | | | |
| I-X | CH0043947545 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | SSP | 49 / 16 | 14.30h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II | | | | | | | | | |
| Benchmark: UBS Bloomberg BCOM Constant Maturity Composite Hedged CHF Total Return | | | | | | | | | |
| I-A1 | CH0126480547 | 0.6200 | 0.01 | 0.00 | 0.63 | SSP | 3 / 3 | 14.30h | Forward Pricing 1 |
| I-B | CH0126480554 | 0.0450 | 0.01 | 0.00 | 0.06 | SSP | 3 / 3 | 14.30h | Forward Pricing 1 |
| I-X | CH0126480562 | 0.0000 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | SSP | 3 / 3 | 14.30h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Government Passive II | | | | | | | | | |
| Benchmark: SBI® Domestic Government (TR) | | | | | | | | | |
| I-A1 | CH0048666470 | 0.1600 | 0.00 | 0.00 | 0.17 | VWS | 15 / 45 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-A3 | CH0048666496 | 0.1400 | 0.00 | 0.00 | 0.14 | VWS | 15 / 45 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-X | CH0048666462 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.01 | VWS | 15 / 45 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II | | | | | | | | | |
| Benchmark: 70% JESG EMBI Global Diversified (hedged CHF), 30% JESG CEMBI Broad Diversified (hedged CHF) ³⁾ | | | | | | | | | |
| I-A1 | CH0244552409 | 0.3000 | 0.00 | 0.00 | 0.30 | VWS | 25 / 66 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-B | CH0244558828 | 0.0550 | 0.00 | 0.00 | 0.06 | VWS | 25 / 66 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-X | CH0244558836 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | VWS | 25 / 66 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II | | | | | | | | | |
| Benchmark: JPM EMBI Global Diversified (CHF hedged) | | | | | | | | | |
| I-X | CH0259022512 | 0.0000 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | VWS | 26 / 68 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II | | | | | | | | | |
| Benchmark: SPI® (TR) | | | | | | | | | |
| I-B | CH0229995755 | 0.0550 | 0.02 | 0.00 | 0.07 | SSP | 10 / 10 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-X | CH0229995763 | 0.0000 | 0.02 | 0.00 | 0.02 | SSP | 10 / 10 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Short Term II | | | | | | | | | |
| Benchmark: SARON 3M compounded ⁴⁾ | | | | | | | | | |
| I-A1 | CH0232004066 | 0.2100 | 0.00 | 0.00 | 0.21 | SSP | 15 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-B | CH0232006095 | 0.0350 | 0.00 | 0.00 | 0.04 | SSP | 15 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| I-X | CH0232006111 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | SSP | 15 / 5 | 15.00h | Forward Pricing 1 |

| Klasse | ISIN | Pauschale Verwaltungs- kommission in % p.a. | Andere Kosten in % p.a. | TER Zielfonds in % p.a. | geprüfte TER in % p.a. | Z / R - Methode | Z / R - Ansatz in Basispunkten | Cut-off time | Forward Pricing Methode |
|---|--------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------------|--------------------|--------------------------------------|-----------------|-------------------------------|
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II | | | | | | | | | |
| Benchmark: SBI® Domestic AAA-BBB 1-5 Jahre (TR) | | | | | | | | | |
| I-X | CH0232004017 | 0.0000 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | VWS | 7 / 22 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II | | | | | | | | | |
| Benchmark: SBI® Foreign AAA-BBB 1-5 Jahre (TR) | | | | | | | | | |
| I-X | CH0232003951 | 0.0000 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | VWS | 10 / 29 | 15.00h | Forward Pricing 1 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II | | | | | | | | | |
| Benchmark: Bloomberg MSCI Global Aggregate ex-CHF Sustainability (hedged CHF) | | | | | | | | | |
| I-X | CH1162399898 | 0.0000 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | VWS | 5 / 15 | 15.00h | Forward Pricing 1 |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

¹⁾ TER Zielfonds abzüglich erhaltener Retrozessionen des Zielfonds. Erhaltene Retrozessionen und Rabatte wurden dem Teilvermögen ausgerichtet

²⁾ Für die Berechnung der anteiligen TER der Zielfonds, die in Immobilien investieren, wurde die TER GAV verwendet.

³⁾ Benchmark bis 30.11.2021 30% JPM CEMBI Diversified hedged in CHF / 70% JPM EMBI Global Diversified, ab 1.12.2021 70% JESG EMBI Global Diversified (hedged CHF) / 30% JESG CEMBI Broad Diversified (hedged CHF).

⁴⁾ Benchmark bis 30.7.2021 Libor CHF 3 Months, ab 1.8.2021 SARON 3M compounded

Wertentwicklung (ungeprüft)

Wertentwicklung vom 1. April 2023 bis zum 31. März 2024

| Teilvermögen | Wertentwicklung des Teilvermögens (in %) ⁽¹⁾ | Wertentwicklung des nachgebildeten Index (in %) ⁽²⁾ | Nachbildungsabweichung (in Prozentpunkten) ⁽³⁾ | Tracking Error (in %) ⁽⁴⁾ |
|--|---|--|---|--------------------------------------|
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II I-A1 | 11.46 | 11.72 | -0.27 | 0.04 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II I-A2 | 11.46 | 11.72 | -0.27 | 0.04 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II I-A3 | 11.48 | 11.72 | -0.24 | 0.04 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II I-B | 11.60 | 11.72 | -0.13 | 0.04 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Swiss Real Estate Securities Selection Passive II I-X | 11.66 | 11.72 | -0.07 | 0.04 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – CHF Exposure I-X | 7.35 | 6.64 | 0.71 | 1.65 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II I-A1 | -4.87 | -3.70 | -1.17 | 0.17 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II I-B | -4.32 | -3.70 | -0.62 | 0.17 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Commodities Constant Maturity (CHF hedged) II I-X | -4.28 | -3.70 | -0.58 | 0.17 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Government Passive II I-A1 | 7.06 | 7.43 | -0.37 | 0.22 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Government Passive II I-A3 | - | 7.43 | -7.43 | - |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Government Passive II I-X | 7.24 | 7.43 | -0.19 | 0.22 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II I-A1 | 4.77 | 5.01 | -0.24 | 0.21 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II I-B | 5.03 | 5.01 | 0.01 | 0.21 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Aggregate ESG Passive (CHF hedged) II I-X | 5.08 | 5.01 | 0.07 | 0.21 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds Emerging Markets Sovereign Passive (CHF hedged) II I-X | 6.81 | 6.45 | 0.37 | 0.21 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II I-B | 5.55 | 6.16 | -0.61 | 1.80 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Equities Switzerland II I-X | 5.61 | 6.16 | -0.55 | 1.80 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Short Term II I-A1 | 2.41 | 1.58 | 0.83 | 0.47 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Short Term II I-B | 2.59 | 1.58 | 1.01 | 0.47 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Short Term II I-X | 2.63 | 1.58 | 1.05 | 0.47 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Inland Medium Term Passive II I-X | 3.76 | 3.64 | 0.12 | 0.12 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Bonds CHF Ausland Medium Term Passive II I-X | 5.73 | 4.56 | 1.17 | 0.72 |
| UBS (CH) Institutional Fund 3 – Global Aggregate Bonds ESG Passive (CHF hedged) II I-X | -0.88 | -0.91 | 0.03 | 0.19 |

¹⁾ Die Daten zur Wertentwicklung der Teilvermögen reflektieren die prozentuale Veränderung der Nettoinventarwerte je Anteile (inklusive Dividende) im Verlauf des Berichtsjahrs.

²⁾ Die Daten zur Wertentwicklung des nachgebildeten Index reflektieren die prozentuale Veränderung der Indizes für die Nettoerträge über das Geschäftsjahr.


³⁾ Die Nachbildungsabweichung ist auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau nachzubilden, dass die erwartete jährliche Renditedifferenz (nach Abzug der Kosten) zwischen der Wertentwicklung der Anteile eines Teilvermögens und dem Index dieses Teilvermögens unter normalen Marktbedingungen höchstens 1% beträgt. In Ausnahmesituationen kann die Renditedifferenz eines Teilvermögens in Bezug auf seinen Index jedoch 1% übersteigen.

⁴⁾ Tracking Error: annualisierte Standardabweichung.

Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, dass der Tracking Error, definiert als die Volatilität der Renditedifferenz zwischen der Wertentwicklung der Anteile eines Teilvermögens und dem Index dieses Teilvermögens unter normalen Marktbedingungen stets bei höchstens 1% liegt. In Ausnahmesituationen kann der Tracking Error eines Teilvermögens jedoch 1% übersteigen.

Berechnung des Tracking Error:

Der Tracking Error für die letzten zwölf Monate wurde nach folgender Formel berechnet: = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

 Follow us on LinkedIn

www.ubs.com

