

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL AGGREGATE

## Halbjahresbericht per 31.07.2024

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art  
«Effektenfonds»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	277967	CHF
BA CHF	42725059	CHF
CT CHF	44168701	CHF
DA CHF	2561683	CHF
GT CHF	20594562	CHF
NT CHF	21580119	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	19
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
7	Pauschale Verwaltungskommission	21
8	Benchmark	21
9	TER	21
10	Fussnoten	22
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.02.2024	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021
	bis	31.07.2024	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		819'702'737.92	791'808'030.23	795'295'053.50	933'394'838.88
<b>Klasse AA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		80'919'767.09	85'935'977.42	105'716'398.64	142'942'516.80
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'351'827.635	1'463'637.686	1'674'928.534	1'955'512.971
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		59.8595	58.7140	63.1170	73.0972
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		59.8176	58.6787	63.0475	73.0606
Ausschüttung je Anteil		-	0.75	0.45	0.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.96 %	0.96 %	0.96 %	0.96 %
<b>Klasse BA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'263'051.55	985'288.61	1'019'261.94	589'661.01
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		15'864.205	12'600.540	12'132.889	6'052.683
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.6164	78.1942	84.0082	97.4214
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		79.5607	78.1472	83.9158	97.3727
Ausschüttung je Anteil		-	1.25	0.85	1.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.59 %	0.59 %	0.59 %	0.59 %
<b>Klasse CT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'937'718.88	2'767'210.04	3'063'553.70	3'675'136.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		34'286.286	33'220.519	34'490.386	35'954.366
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.6820	83.2982	88.8234	102.2167
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		85.6221	83.2482	88.7257	102.1656
Thesaurierung je Anteil		-	1.43	0.95	1.11
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
<b>Klasse DA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		15'123'799.78	14'981'047.30	16'614'787.89	19'733'724.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		220'605.473	222'405.473	229'335.473	234'785.473
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		68.5559	67.3592	72.4475	84.0500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		68.5079	67.3188	72.3678	84.0080
Ausschüttung je Anteil		-	1.15	0.90	1.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.46 %	0.46 %	0.46 %	0.46 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'417'547.37	11'141'834.06	61'808'776.29	69'762'668.81
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		133'554.618	123'284.618	641'812.618	629'920.618
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.9773	90.3749	96.3035	110.7484
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.9122	90.3207	96.1975	110.6930
Thesaurierung je Anteil		-	1.65	1.15	1.32
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.39 %	0.39 %	0.39 %	0.39 %

<b>Klasse NT CHF</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	707'040'853.25	675'996'672.80	607'072'275.04	696'691'131.35
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	7'405'555.084	7'288'655.084	6'157'135.698	6'159'104.505
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	95.4744	92.7464	98.5965	113.1157
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	95.4076	92.6908	98.4881	113.0591
Thesaurierung je Anteil	-	2.05	1.56	1.79
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.01 %	0.01 %	0.01 %	0.01 %

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

## Performance

	<b>2023 / 2024</b>	<b>2023</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Klasse AA CHF	3.21 %	-4.50 %	-15.35 %	-3.05 %
Klasse BA CHF	3.40 %	-4.15 %	-15.04 %	-2.68 %
Klasse CT CHF	3.45 %	-4.06 %	-14.96 %	-2.60 %
Klasse DA CHF	3.48 %	-4.07 %	-14.83 %	-2.55 %
Klasse GT CHF	3.52 %	-4.00 %	-14.77 %	-2.49 %
Klasse NT CHF	3.71 %	-3.64 %	-14.45 %	-2.12 %

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

## Vermögensrechnung

<b>(Verkehrswerte)</b>	<b>31.07.2024</b>	<b>31.01.2024</b>
Bankguthaben auf Sicht	11'381'834.04	24'545'764.93
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	762'219'672.43	723'248'174.07
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	38'051'529.77	36'998'734.10
Derivative Finanzinstrumente	1'335'390.73	327'379.82
Sonstige Vermögenswerte	6'796'535.10	6'773'636.04
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>819'784'962.07</b>	<b>791'893'688.96</b>
Andere Verbindlichkeiten	-82'224.15	-85'658.73
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>819'702'737.92</b>	<b>791'808'030.23</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
<b>Klasse AA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'463'637.686	1'674'928.534
Ausgegebene Anteile		3'926.000	6'197.602
Zurückgenommene Anteile		-115'736.051	-217'488.450
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'351'827.635</b>	<b>1'463'637.686</b>
<b>Klasse BA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'600.540	12'132.889
Ausgegebene Anteile		3'649.665	1'307.651
Zurückgenommene Anteile		-386.000	-840.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>15'864.205</b>	<b>12'600.540</b>
<b>Klasse CT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		33'220.519	34'490.386
Ausgegebene Anteile		1'606.197	1'927.000
Zurückgenommene Anteile		-540.430	-3'196.867
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>34'286.286</b>	<b>33'220.519</b>
<b>Klasse DA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		222'405.473	229'335.473
Zurückgenommene Anteile		-1'800.000	-6'930.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>220'605.473</b>	<b>222'405.473</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		123'284.618	641'812.618
Ausgegebene Anteile		12'448.000	46'638.000
Zurückgenommene Anteile		-2'178.000	-565'166.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>133'554.618</b>	<b>123'284.618</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'288'655.084	6'157'135.698
Ausgegebene Anteile		116'900.000	1'555'951.000
Zurückgenommene Anteile		-	-62'213.000
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-362'218.614
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>7'405'555.084</b>	<b>7'288'655.084</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		791'808'030.23	795'295'053.50
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'324'769.48	-943'824.95
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'331'288.50	-3'653'235.16
Saldo aus dem Anteilverkehr		5'506'591.75	43'080'018.06
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		29'044'173.92	-41'969'981.22
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>819'702'737.92</b>	<b>791'808'030.23</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.02.2024 31.07.2024</b>	<b>01.02.2023 31.01.2024</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		229'269.25	345'824.01
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-577.77	-10'208.43
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		11'427'310.42	15'143'296.62
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		661'508.34	1'162'002.06
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		142'371.22	2'133'274.63
<b>Total Ertrag</b>		<b>12'459'881.46</b>	<b>18'774'188.89</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-2'736.55	-3.45
Reglementarische Vergütungen		-466'151.00	-1'101'668.13
Sonstige Aufwendungen		-102.65	-168.48
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-41'737.12	-1'122'214.87
<b>Total Aufwand</b>		<b>-510'727.32</b>	<b>-2'224'054.93</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>11'949'154.14</b>	<b>16'550'133.96</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-13'182'454.01	-79'095'524.40
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		0.00	69'059.34
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		12'083.66	164'336.05
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-1'221'216.21</b>	<b>-62'311'995.05</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		30'265'390.13	20'342'013.83
<b>Gesamterfolg</b>		<b>29'044'173.92</b>	<b>-41'969'981.22</b>



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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>800'271'202.20</b>	<b>97.62</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>762'219'672.43</b>	<b>92.98</b>	
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	1'500	0	0	1'500 AUD	98.76%	851'548.02	0.10	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	2'200	0	0	2'200 AUD	55.95%	707'500.03	0.09	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	700	0	0	700 AUD	91.57%	368'435.09	0.04	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	1'000	0	0	1'000 AUD	88.10%	506'418.91	0.06	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	600	0	0	600 AUD	77.65%	267'787.04	0.03	a)
AU3CB0246221	4.0500 % VZ 4.05 02/17/25 MTN	1'800	0	0	1'800 AUD	99.55%	1'029'979.60	0.13	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	2'000	0	0	2'000 AUD	95.35%	1'096'184.29	0.13	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	400	0	400	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0279818	0.8000 % ASIA 0.8 11/06/25 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	95.74%	550'287.89	0.07	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	1'500	0	0	1'500 AUD	98.34%	847'926.76	0.10	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	1'700	0	0	1'700 AUD	82.97%	810'783.55	0.10	a)
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	2'000	0	0	2'000 AUD	75.32%	865'860.62	0.11	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	2'000	0	0	2'000 AUD	76.13%	875'241.41	0.11	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	3'000	0	0	3'000 AUD	89.85%	1'549'330.43	0.19	a)
<b>AUD</b>							<b>10'327'283.64</b>	<b>1.26</b>	
CA1107098Y17	4.3000 % BRCOL 4.3 06/18/42	0	5'000	0	5'000 CAD	100.90%	3'214'701.40	0.39	a)
CA110709GN67	3.5500 % BRCOL 3.55 06/18/33	0	8'000	4'000	4'000 CAD	98.17%	2'502'103.20	0.31	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	4'100	0	4'100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	12'000	11'000	2'900	20'100 CAD	85.24%	10'917'305.24	1.33	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	6'000	2'000	8'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	4'000	0	4'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZFL28	2.8500 % Q 2.85 12/01/53	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CAC69798AZ64	4.3000 % ONTFT 4.3 06/02/34	0	6'500	0	6'500 CAD	102.58%	4'248'610.43	0.52	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	93.29%	1'188'899.81	0.15	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REG5	2'500	0	2'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
<b>CAD</b>							<b>22'071'620.08</b>	<b>2.69</b>	
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	3'000	0	0	3'000 CHF	109.85%	3'295'500.00	0.40	a)
<b>CHF</b>							<b>3'295'500.00</b>	<b>0.40</b>	
CND100009CN7	3.8000 % SDHC 3.8 01/25/36 1605	4'000	0	4'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000HWX0	3.5900 % CGB 3.59 08/03/27 1718	15'000	0	15'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100011220	4.0400 % SDHC 4.04 07/06/28 1810	30'000	0	30'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	40'000	0	40'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	50'000	0	50'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	55'000	20'000	0	75'000 CNY	119.10%	10'879'172.92	1.33	a)
CND10004NXW0	2.8900 % CGB 2.89 11/18/31 INBK	25'000	0	0	25'000 CNY	105.84%	3'222'626.41	0.39	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	25'000	0	0	25'000 CNY	106.16%	3'232'217.38	0.39	a)
CND100067578	2.8000 % CGB 2.8 03/25/30 INBK	25'000	0	25'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10006GPT1	2.6700 % CGB 2.67 05/25/33 INBK	65'000	0	65'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000716X4	3.0000 % CGB 3 10/15/53 INBK	12'000	0	12'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000716Y2	2.5500 % CGB 2.55 10/15/28 INBK	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100076348	2.6700 % CGB 2.67 11/25/33 INBK	25'000	0	0	25'000 CNY	104.47%	3'180'852.41	0.39	a)
CND10007C5P4	2.3700 % CGB 2.37 01/15/29 INBK	0	44'000	44'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10007LB61	2.3500 % CGB 2.35 02/25/34 INBK	0	45'000	0	45'000 CNY	101.78%	5'578'326.68	0.68	a)
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	100.13%	1'219'532.79	0.15	a)
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	100.45%	3'670'144.06	0.45	a)
XS2472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	0	70'000	0	70'000 CNY	100.47%	8'565'459.79	1.04	a)
XS2577528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	40'000	40'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	0	70'000	0	70'000 CNY	99.44%	8'477'222.88	1.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52808428853	2.7500 % KFW 2 3/4 04/26/27 EMTN	0	70'000	0	70'000 CNY	100.93%	8'604'931.95	1.05	a)
X52868924189	2.7500 % IBRD 2 3/4 07/26/34 EMTN	0	40'000	0	40'000 CNY	100.35%	4'888'799.96	0.60	a)
<b>CNY</b>							<b>61'519'287.23</b>	<b>7.50</b>	
X51821973606	6.7700 % CAF 6.77 05/24/28 EMTN	10'000'000	0	0	10'000'000 COP	87.75%	1'902'881.44	0.23	a)
<b>COP</b>							<b>1'902'881.44</b>	<b>0.23</b>	
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	4'500	0	0	4'500 DKK	100.98%	580'052.43	0.07	a)
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	3'000	0	0	3'000 DKK	125.36%	480'075.08	0.06	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	8'000	0	0	8'000 DKK	98.86%	1'009'565.38	0.12	a)
<b>DKK</b>							<b>2'069'692.89</b>	<b>0.25</b>	
AT0000A2W5C8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	1'500	0	0	1'500 EUR	87.91%	1'256'022.91	0.15	a)
AT0000A32458	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	1'700	0	0	1'700 EUR	101.03%	1'636'023.10	0.20	a)
AT0000A32562	4.0000 % ERSTBK 4 01/16/31	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	0	3'000	0	3'000 EUR	63.80%	1'823'204.22	0.22	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	3'000	0	0	3'000 EUR	101.63%	2'904'130.61	0.35	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002922038	3.2500 % WALLOO 3 1/4 06/22/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0390149152	5.1250 % SCRSBE 5 1/8 07/17/30	0	1'600	0	1'600 EUR	101.83%	1'551'917.71	0.19	a)
BE6350791073	3.8750 % SOLBBB 3 7/8 04/03/28	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	2'550	2'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6352762387	3.6250 % CCBGBB 3 5/8 06/11/30 EMTN	0	4'000	1'500	2'500 EUR	101.53%	2'417'703.73	0.29	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'000	0	0	2'000 EUR	94.52%	1'800'639.08	0.22	a)
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	2'500	0	0	2'500 EUR	99.93%	2'379'531.59	0.29	a)
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	2'700	0	1'500	1'200 EUR	105.17%	1'202'092.33	0.15	a)
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	1'500	0	0	1'500 EUR	102.78%	1'468'424.79	0.18	a)
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	2'200	0	0	2'200 EUR	102.79%	2'153'941.16	0.26	a)
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	900	0	900 EUR	101.60%	870'956.28	0.11	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	10'000	15'000	0	25'000 EUR	87.95%	20'942'287.88	2.55	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	3'000	2'000	0	5'000 EUR	52.92%	2'520'170.80	0.31	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	10'500	0	1'500	9'000 EUR	94.85%	8'130'994.19	0.99	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	7'000	0	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	0	3'000	0	3'000 EUR	83.04%	2'372'854.44	0.29	a)
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	2'100	0	0	2'100 EUR	100.66%	2'013'488.64	0.25	a)
DE000A30VHW7	1.5000 % NIESA 1 1/2 10/17/29	1'200	0	0	1'200 EUR	94.41%	1'079'103.27	0.13	a)
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	2'000	0	0	2'000 EUR	104.98%	1'999'886.69	0.24	a)
DE000A30VUK5	2.7500 % KFW 2 3/4 03/15/28 EMTN	3'500	0	0	3'500 EUR	100.59%	3'353'614.09	0.41	a)
DE000A351U49	5.8240 % ALVGR 5.824 07/25/53	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	3'200	800	0	4'000 EUR	101.25%	3'857'619.67	0.47	a)
DE000A3E5MK0	1.5000 % ANNGR 1 1/2 06/14/41	1'000	0	0	1'000 EUR	67.38%	641'796.77	0.08	a)
DE000A3E5XN1	0.1250 % KFW 0 1/8 01/09/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	83.33%	793'713.78	0.10	a)
DE000A3LWGE2	3.7500 % TRAGR 3 3/4 03/27/27 EMTN	0	2'400	400	2'000 EUR	100.78%	1'919'818.07	0.23	a)
DE000A3LWGF9	3.7500 % TRAGR 3 3/4 03/27/30 EMTN	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3LZUB2	3.2500 % ALVGR 3 1/4 12/04/29 EMTN	0	1'800	0	1'800 EUR	101.47%	1'739'786.55	0.21	a)
DE000A3MP4W5	1.6250 % ANNGR 1 5/8 09/01/51 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	59.15%	563'366.48	0.07	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	7'000	0	2'000	5'000 EUR	100.99%	4'809'594.24	0.59	a)
DE000NRW0NP7	3.0000 % NRW 3 01/27/28	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NWB0AL1	0.0000 % NRWK 0 02/03/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	83.87%	1'597'695.70	0.19	a)
DK0030393665	3.8750 % NYKRE 3 7/8 07/05/27 EMTN	0	1'800	0	1'800 EUR	101.40%	1'738'603.52	0.21	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	3'000	0	0	3'000 EUR	93.47%	2'670'868.60	0.33	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	5'000	0	0	5'000 EUR	101.33%	4'825'739.41	0.59	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	4'500	0	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00001010I2	1.7230 % MADRID 1.723 04/30/32	1'000	0	0	1'000 EUR	90.67%	863'676.19	0.11	a)
ES0205046008	4.2500 % AENASM 4 1/4 10/13/30 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G30R0	3.3750 % EU 3 3/8 04/04/38 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	0	5'500	0	5'500 EUR	99.74%	5'225'330.03	0.64	a)
EU000A3K4E80	0.0000 % EUB 0 02/09/24 6M	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EY2	3.3750 % EU 3 3/8 10/05/54 NGEU	0	2'000	0	2'000 EUR	100.08%	1'906'559.03	0.23	a)
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	3'000	0	0	3'000 EUR	55.78%	1'594'057.09	0.19	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013203825	1.2500 % LIFP 1 1/4 09/29/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	85.28%	812'297.40	0.10	a)
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	82.83%	788'979.77	0.10	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 OAT	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400A3H2	1.5000 % CADES 1 1/2 05/25/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	90.15%	1'202'119.00	0.15	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32 OAT	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DNU4	3.1250 % SNCF 3 1/8 11/02/27	1'300	0	0	1'300 EUR	100.20%	1'240'749.30	0.15	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54 OAT	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33 OAT	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29 OAT	4'000	0	2'000	2'000 EUR	100.19%	1'908'578.37	0.23	a)
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	3'000	0	1'000	2'000 EUR	103.03%	1'962'662.31	0.24	a)
FR001400KDS4	5.5000 % ACAFP 5 1/2 08/28/33 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	1'800	0	300	1'500 EUR	105.28%	1'504'144.20	0.18	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33 OAT	0	6'500	4'000	2'500 EUR	104.44%	2'486'999.38	0.30	a)
FR001400LWN3	4.7500 % BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	106.37%	1'519'732.15	0.19	a)
FR001400O457	3.8750 % AYVFP 3 7/8 02/22/27	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400P8C5	4.0000 % TRATOU 4 04/08/39 EMTN	0	4'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400PGC0	4.3750 % ACAFP 4 3/8 04/15/36	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400PIA0	5.8750 % ELOFR 5 7/8 04/17/28 EMTN	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
GR0138018842	4.1250 % GGB 4 1/8 06/15/54	0	4'250	4'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	2'000	0	1'000	1'000 EUR	83.61%	796'399.88	0.10	a)
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	2'000	0	0	2'000 EUR	104.46%	1'989'904.31	0.24	a)
IT0005568529	4.1250 % BPSOIM 4 1/8 10/24/28	2'500	0	0	2'500 EUR	103.41%	2'462'567.31	0.30	a)
IT0005582421	4.1500 % BTPS 4.15 10/01/39 15Y	0	3'400	1'400	2'000 EUR	101.87%	1'940'678.20	0.24	a)
IT0005584856	3.8500 % BTPS 3.85 07/01/34 10Y	0	5'500	5'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005596470	4.0500 % BTPS 4.05 10/30/37 13Y	0	5'400	5'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	0	11'000	8'000	3'000 EUR	69.65%	1'990'199.59	0.24	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	3'000	0	0	3'000 EUR	99.64%	2'847'179.58	0.35	a)
PTEDPUOM0008	3.8750 % EDPLP 3 7/8 06/26/28 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	102.26%	1'071'427.88	0.13	a)
PTOTEYOE0031	1.6500 % PGB 1.65 07/16/32	2'000	0	0	2'000 EUR	92.48%	1'761'833.52	0.21	a)
SK4000022539	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 02/23/35 245	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2112475921	1.0000 % PLD 1 02/06/35	1'000	0	0	1'000 EUR	77.01%	733'552.78	0.09	a)
XS2193983108	1.9080 % VTRS 1.908 06/23/32	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	1'800	0	0	1'800 EUR	82.96%	1'422'443.91	0.17	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	81.96%	780'635.72	0.10	a)
XS2289593670	0.0100 % DNBNO 0.01 01/21/31	1'000	0	0	1'000 EUR	83.40%	794'351.97	0.10	a)
XS2293755125	0.0000 % ICELND 0 04/15/28	0	3'000	0	3'000 EUR	89.40%	2'554'737.66	0.31	a)
XS2332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	79.35%	1'511'550.02	0.18	a)
XS2358287238	0.0100 % UBS 0.01 06/29/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	94.40%	1'348'693.34	0.16	a)
XS2387052744	0.8750 % CASTSS 0 7/8 09/17/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2390400716	0.6250 % ENELIM 0 3/8 05/28/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	88.68%	2'534'134.71	0.31	a)
XS2407197545	0.2500 % AUCCCN 0 1/4 11/17/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	82.35%	784'379.11	0.10	a)
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	93.18%	1'863'907.20	0.23	a)
XS2435663393	0.2500 % KUNTA 0 1/4 02/25/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	82.89%	1'105'385.13	0.13	a)
XS2475513953	1.8500 % ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	91.25%	1'303'729.75	0.16	a)
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	97.28%	1'575'283.92	0.19	a)
XS2539371653	3.3000 % ONTTFT 3.3 10/05/29 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	101.69%	1'452'965.43	0.18	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	1'300	0	0	1'300 EUR	103.18%	1'277'686.97	0.16	a)
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	101.30%	1'929'781.40	0.24	a)
XS2588986997	5.0000 % INTNED 5 02/20/35 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2590268814	3.0000 % KUNTA 3 09/25/28 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	101.18%	1'060'080.54	0.13	a)
XS2596599063	4.6990 % NWG 4.699 03/14/28 EMTN	750	0	0	750 EUR	103.30%	737'941.50	0.09	a)
XS2597696124	4.0000 % DNBNO 4 03/14/29 EMTN	1'350	0	0	1'350 EUR	102.48%	1'317'827.49	0.16	a)
XS2611177382	3.1000 % IBRD 3.1 04/14/38 GMTN	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2613209670	4.3750 % SYDAU 4 3/8 05/03/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2613658710	4.3750 % ABNANV 4 3/8 10/20/28	1'500	0	0	1'500 EUR	103.82%	1'483'369.79	0.18	a)
XS2623518821	4.7710 % NWG 4.771 02/16/29 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	104.26%	2'482'641.61	0.30	a)
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	101.41%	1'159'183.32	0.14	a)
XS2631822868	3.5000 % STATK 3 1/2 06/09/33 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	101.79%	1'551'247.14	0.19	a)
XS2631835332	3.5000 % STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	101.99%	1'457'137.46	0.18	a)
XS2636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2637069357	6.7500 % ACHMEA 6 3/4 12/26/43 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	1'400	0	0	1'400 EUR	106.23%	1'416'549.74	0.17	a)
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2673969650	5.2500 % IDSLN 5 1/4 09/14/28	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	2'400	0	0	2'400 EUR	103.56%	2'367'356.51	0.29	a)
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	3'000	0	0	3'000 EUR	104.43%	2'983'999.20	0.36	a)
XS2679765037	6.3750 % LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 EUR	105.79%	2'015'279.38	0.25	a)
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	2'600	0	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2723597923	3.1250 % STATK 3 1/8 12/13/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	100.08%	2'859'724.24	0.35	a)
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2739132897	3.8750 % ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	101.82%	1'648'734.45	0.20	a)
XS2740452649	3.3200 % SHNHAN 3.32 01/29/27	2'800	0	0	2'800 EUR	100.32%	2'675'450.20	0.33	a)
XS2742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	1'950	0	1'950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2744491874	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 01/10/34	2'100	0	0	2'100 EUR	98.08%	1'961'941.25	0.24	a)
XS2745115837	3.6250 % NWW 3 5/8 01/09/29 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	101.34%	1'737'471.93	0.21	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2754067242	4.4899 % MEX 4.4899 05/25/32	3'200	0	0	3'200 EUR	100.31%	3'057'352.57	0.37	a)
XS2765498717	3.5000 % LITHUN 3 1/2 02/13/34 EMTN	0	4'900	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2770920937	5.3750 % ROMANI 5 3/8 03/22/31 REGS	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2770921315	5.6250 % ROMANI 5 5/8 02/22/36 REGS	0	1'070	1'070	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2776519980	4.0000 % MELAIR 4 06/07/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	102.04%	1'943'897.71	0.24	a)
XS2778272471	4.0000 % BGOSK 4 03/13/32 EMTN	0	1'700	200	1'500 EUR	101.48%	1'449'979.29	0.18	a)
XS2778274410	4.3750 % BGOSK 4 3/8 03/13/39 EMTN	0	1'900	400	1'500 EUR	101.13%	1'444'921.42	0.18	a)
XS2779793061	3.7500 % STATK 3 3/4 03/22/39 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2779814750	5.0000 % LANBNN 5 05/13/28 EMTN	0	1'050	1'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2779881601	3.7500 % AALLN 3 3/4 06/15/29	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2779901482	4.1250 % AALLN 4 1/8 03/15/32	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	2'300	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2788435050	3.5000 % ICELND 3 1/2 03/21/34	0	2'450	2'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2790333707	3.7900 % MS 3.79 03/21/30	0	4'200	1'700	2'500 EUR	101.46%	2'416'155.89	0.29	a)
XS2790333889	3.9550 % MS 3.955 03/21/35 EMTN	0	3'700	1'200	2'500 EUR	101.63%	2'420'204.09	0.30	a)
XS2791972248	3.7610 % JPM 3.761 03/21/34 EMTN	0	3'800	800	3'000 EUR	101.65%	2'904'702.12	0.35	a)
XS2792180197	4.6250 % ISLBN 4 5/8 03/27/28	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2804565435	3.5000 % BNS 3 1/2 04/17/29 EMTN	0	6'600	2'600	4'000 EUR	100.62%	3'833'768.64	0.47	a)
XS2806452145	4.8750 % EUROB 4 7/8 04/30/31 EMTN	0	4'125	4'125	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2809859536	5.6250 % ACHMEA 5 5/8 11/02/44 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2817920080	4.6250 % ARION 4 5/8 11/21/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	102.35%	1'949'860.47	0.24	a)
XS2828685631	5.7500 % GLJGR 5 3/4 07/06/29 EMTN	0	5'600	5'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2829852842	4.5000 % ALLRNV 4 1/2 PERP	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2830466137	3.9000 % AMT 3.9 05/16/30	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2834471463	3.3750 % AXASA 3 3/8 05/31/34 EMTN	0	3'800	1'300	2'500 EUR	100.77%	2'399'701.15	0.29	a)
XS2835902243	3.6250 % BBVASM 3 5/8 06/07/30	0	5'000	0	5'000 EUR	101.60%	4'838'979.40	0.59	a)
XS2838370414	4.2500 % CEZCP 4 1/4 06/11/32 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2838538374	4.2500 % MOTOPG 4 1/4 06/17/35 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	103.34%	2'952'851.88	0.36	a)
XS2838886062	2.8750 % BNG 2 7/8 06/11/31 EMTN	0	8'000	0	8'000 EUR	100.78%	7'679'424.69	0.94	a)
XS2844398482	4.2500 % SDFGR 4 1/4 06/19/29	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2847688251	4.3750 % PRIFI 4 3/8 07/01/36 EMTN	0	2'200	0	2'200 EUR	103.58%	2'170'558.78	0.26	a)
XS2855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	900	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2856698126	3.4500 % DE 3.45 07/16/32 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	101.34%	2'895'872.28	0.35	a)
XS2860457071	4.8000 % ARNDTN 4.8 07/16/29 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2865588797	3.3500 % Q 3.35 07/23/39 EMTN	0	7'000	0	7'000 EUR	100.67%	6'712'428.92	0.82	a)
XS2872909770	3.2780 % AZN 3.278 08/05/33 EMTN	0	4'300	300	4'000 EUR	100.32%	3'822'338.43	0.47	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>EUR</b>							<b>235'693'817.29</b>	<b>28.75</b>	
DE000A3LSV01	5.6250 % TRAGR 5 5/8 01/16/29 EMTN	2'500	0	500	2'000 GBP	100.96%	2'282'937.23	0.28	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	1'700	0	0	1'700 GBP	104.31%	2'004'886.43	0.24	a)
FR001400NCB6	5.7500 % SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN	1'500	0	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400QIH3	5.3750 % BPCEGP 5 3/8 10/22/31 EMTN	0	4'000	1'000	3'000 GBP	100.73%	3'416'536.61	0.42	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	900	0	900	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	3'900	0	0	3'900 GBP	51.76%	2'282'305.20	0.28	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	6'400	1'600	0	8'000 GBP	30.95%	2'799'095.68	0.34	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	2'500	0	0	2'500 GBP	69.88%	1'975'223.03	0.24	a)
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1979281158	2.5000 % VZ 2 1/2 04/08/31	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2200513153	1.1250 % NGGLN 1 1/8 07/07/28 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	900	0	900	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2476782631	2.1250 % NRW 2 1/8 06/13/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	97.66%	1'656'321.18	0.20	a)
XS2507889835	2.7500 % IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	98.03%	2'216'817.57	0.27	a)
XS2540612129	6.3750 % NWG 6 3/8 11/08/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 GBP	104.72%	1'539'233.53	0.19	a)
XS2590262296	5.1250 % ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	101.21%	1'716'425.85	0.21	a)
XS2630420268	6.6250 % ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	107.36%	1'820'845.84	0.22	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	1'800	0	1'800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2811733240	4.8750 % NYLIFE 4 7/8 04/30/31 EMTN	0	4'100	1'100	3'000 GBP	101.62%	3'446'758.54	0.42	a)
XS2838520836	5.7500 % MOTOPG 5 3/4 06/17/51 EMTN	0	900	900	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
<b>GBP</b>							<b>27'157'386.69</b>	<b>3.31</b>	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	95.51%	1'676'347.35	0.20	a)
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	98.09%	1'147'776.31	0.14	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	1'900'000	0	900'000	1'000'000 JPY	98.44%	5'759'123.92	0.70	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	1'490'000	0	0	1'490'000 JPY	88.33%	7'699'623.39	0.94	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	1'450'000	200'000	0	1'650'000 JPY	88.68%	8'560'697.25	1.04	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	700'000	0	0	700'000 JPY	90.99%	3'726'247.95	0.45	a)
JP1300531GCO	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	900'000	0	0	900'000 JPY	75.60%	3'980'552.70	0.49	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	600'000	1'400'000	0	2'000'000 JPY	74.57%	8'725'154.64	1.06	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	440'000	0	0	440'000 JPY	91.97%	2'367'517.10	0.29	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	940'000	0	940'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0257403278	2.3000 % DBJP 2.3 03/19/26 INTL	540'000	0	0	540'000 JPY	102.87%	3'249'785.17	0.40	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	99.61%	2'331'099.60	0.28	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	98.34%	1'726'052.26	0.21	a)
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	340'000	0	0	340'000 JPY	99.97%	1'988'555.75	0.24	a)
<b>JPY</b>							<b>52'938'533.39</b>	<b>6.46</b>	
KR103502GB33	1.8750 % KTB 1 7/8 03/10/51 5103	3'200'000	0	0	3'200'000 KRW	80.67%	1'650'483.01	0.20	a)
KR103502GD31	3.2500 % KTB 3 1/4 03/10/53 5303	4'000'000	0	0	4'000'000 KRW	105.40%	2'695'483.98	0.33	a)
<b>KRW</b>							<b>4'345'966.99</b>	<b>0.53</b>	
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	850'000	0	0	850'000 MXN	86.64%	3'479'636.73	0.42	a)
<b>MXN</b>							<b>3'479'636.73</b>	<b>0.42</b>	
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	12'000	0	0	12'000 MYR	98.97%	2'275'441.96	0.28	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200 MYR	100.86%	38'647.85	0.00	a)
<b>MYR</b>							<b>2'314'089.81</b>	<b>0.28</b>	
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	12'600	0	0	12'600 NOK	100.89%	1'023'374.00	0.12	a)
<b>NOK</b>							<b>1'023'374.00</b>	<b>0.12</b>	
NZ1IBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	1'200	0	0	1'200 NZD	129.73%	813'918.53	0.10	a)
<b>NZD</b>							<b>813'918.53</b>	<b>0.10</b>	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	3'000	0	0	3'000 PLN	102.35%	681'047.25	0.08	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	3'000	0	3'000	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
XS1785345486	3.0100 % EBRD 3.01 03/13/28 GDIF	0	8'650	0	8'650 PLN	92.03%	1'765'794.19	0.22	a)
<b>PLN</b>							<b>2'446'841.44</b>	<b>0.30</b>	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000 SEK	117.27%	481'588.96	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	5'000	0	0	5'000 SEK	97.51%	400'426.85	0.05	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	0	0	5'000 SEK	88.71%	364'276.78	0.04	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	10'000	0	0	10'000 SEK	89.79%	737'423.73	0.09	a)
<b>SEK</b>							<b>1'983'716.32</b>	<b>0.24</b>	
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	400	0	0	400 SGD	103.92%	273'546.11	0.03	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	500	0	0	500 SGD	100.21%	329'715.35	0.04	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	1'150	0	0	1'150 SGD	80.40%	608'484.99	0.07	a)
<b>SGD</b>							<b>1'211'746.45</b>	<b>0.15</b>	
TH0623035605	0.9500 % THAIGB 0.95 06/17/25	40'000	0	0	40'000 THB	98.77%	975'597.11	0.12	a)
TH0623038302	5.6700 % THAIGB 5.67 03/13/28	9'000	0	0	9'000 THB	111.22%	247'184.44	0.03	a)
TH0623A3N603	3.4500 % THAIGB 3.45 06/17/43	33'000	0	0	33'000 THB	105.76%	861'896.56	0.11	a)
<b>THB</b>							<b>2'084'678.11</b>	<b>0.25</b>	
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	6'500	4'000	2'500 USD	101.26%	2'228'418.89	0.27	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZLN 5.355 08/14/28 REGS	1'900	0	0	1'900 USD	102.33%	1'711'510.57	0.21	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	1'200	0	0	1'200 USD	69.90%	738'300.89	0.09	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	93.15%	1'639'976.17	0.20	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	2'100	0	0	2'100 USD	101.80%	1'881'872.39	0.23	a)
US00287YDW66	5.4000 % ABBV 5.4 03/15/54	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MAV72	2.4500 % AER 2.45 10/29/26	1'500	0	0	1'500 USD	94.31%	1'245'192.85	0.15	a)
US00774MAW55	3.0000 % AER 3 10/29/28	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US008281BF39	5.7500 % AFDB 5 3/4 PERP	0	3'000	0	3'000 USD	97.52%	2'575'127.36	0.31	a)
US009158BH84	4.6000 % APD 4.6 02/08/29	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US009158BJ41	4.7500 % APD 4 3/4 02/08/31	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US009158BK14	4.8500 % APD 4.85 02/08/34	0	4'500	2'500	2'000 USD	100.28%	1'765'376.59	0.22	a)
US03027XAX84	2.7500 % AMT 2 3/4 01/15/27	1'500	0	0	1'500 USD	95.06%	1'255'161.68	0.15	a)
US031162CZ14	2.0000 % AMGN 2 01/15/32	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	2'000	0	0	2'000 USD	62.22%	1'095'418.31	0.13	a)
US045167FP34	3.1250 % ASIA 3 1/8 08/20/27 GMTN	3'900	0	0	3'900 USD	97.12%	3'334'036.66	0.41	a)
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	0	2'500	0	2'500 USD	90.41%	1'989'585.06	0.24	a)
US05581LAG41	5.8940 % BNP 5.894 12/05/34 REGS	3'400	0	0	3'400 USD	104.75%	3'134'890.66	0.38	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	2'800	0	2'800 USD	101.92%	2'511'899.01	0.31	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	4'000	0	0	4'000 USD	92.88%	3'270'269.59	0.40	a)
US05964HBB06	5.5380 % SANTAN 5.538 03/14/30	0	3'400	1'400	2'000 USD	101.00%	1'778'016.98	0.22	a)
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	1'500	0	0	1'500 USD	96.55%	1'274'861.67	0.16	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	0	1'000	0	1'000 USD	90.31%	794'971.38	0.10	a)
US06407FZE11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	1'650	0	0	1'650 USD	94.06%	1'366'081.10	0.17	a)
US06428CAA27	5.5260 % BAC 5.526 08/18/26	4'000	0	0	4'000 USD	101.54%	3'575'329.03	0.44	a)
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	4'000	0	0	4'000 USD	100.69%	3'545'224.48	0.43	a)
US06738EAU91	4.3370 % BACR 4.337 01/10/28	2'000	0	0	2'000 USD	97.77%	1'721'170.43	0.21	a)
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	700	0	0	700 USD	101.04%	622'570.90	0.08	a)
US105756CK49	6.1250 % BRAZIL 6 1/8 01/22/32	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EF17	4.9000 % BMY 4.9 02/22/29	0	3'700	700	3'000 USD	101.58%	2'682'341.81	0.33	a)
US110122EG99	5.1000 % BMY 5.1 02/22/31	0	1'350	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	1'500	0	0	1'500 USD	93.34%	1'232'424.82	0.15	a)
US12636YAE23	5.4000 % CRHID 5.4 05/21/34	0	5'000	2'000	3'000 USD	101.63%	2'683'873.45	0.33	a)
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12704PAA66	5.2000 % CRHID 5.2 05/21/29	0	5'000	2'000	3'000 USD	101.72%	2'686'038.86	0.33	a)
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	2'050	0	0	2'050 USD	98.51%	1'777'643.31	0.22	a)
US15135BAV36	3.3750 % CNC 3 3/8 02/15/30	2'500	0	0	2'500 USD	90.54%	1'992'401.86	0.24	a)
US161175CP73	6.6500 % CHTR 6.65 02/01/34	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US168863DL94	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/25/50	2'000	0	0	2'000 USD	73.53%	1'294'495.65	0.16	a)
US172967NX53	5.6100 % C 5.61 09/29/26	1'500	0	0	1'500 USD	100.43%	1'325'986.59	0.16	a)
US17325FBJ66	4.9290 % C 4.929 08/06/26	0	2'400	0	2'400 USD	100.21%	2'117'099.84	0.26	a)
US17325FBK30	4.8380 % C 4.838 08/06/29	0	3'025	0	3'025 USD	100.52%	2'676'709.09	0.33	a)
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	2'050	0	0	2'050 USD	99.73%	1'799'658.36	0.22	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	2'550	0	0	2'550 USD	103.43%	2'321'718.35	0.28	a)
US22535EAG26	5.5140 % ACAFP 5.514 07/05/33 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	103.61%	1'823'983.63	0.22	a)
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	2'500	0	0	2'500 USD	99.77%	2'195'475.54	0.27	a)
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278GAP37	2.5000 % ENELIM 2 1/4 07/12/31 144A	2'000	0	0	2'000 USD	83.94%	1'477'816.52	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US29881WAD48	0.3750 % ESM 0 3/8 09/10/25 144A	1'500	0	0	1'500 USD	95.36%	1'259'043.58	0.15	a)
US30216BKF84	4.7500 % EDC 4 3/4 06/05/34	0	2'950	0	2'950 USD	104.73%	2'719'459.31	0.33	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XEQ51	5.4000 % GM 5.4 05/08/27	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XER35	5.7500 % GM 5 3/4 02/08/31	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	1'250	0	0	1'250 USD	94.41%	1'038'849.04	0.13	a)
US38143U8H71	3.7500 % GS 3 3/4 02/25/26	2'000	0	0	2'000 USD	98.30%	1'730'606.71	0.21	a)
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	675	0	0	675 USD	100.46%	596'907.87	0.07	a)
US404280DQ93	7.3360 % HSBC 7.336 11/03/26	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US41283LBB09	5.9500 % HOG 5.95 06/11/29 144A	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US427028AB18	0.7500 % CANADA 0 3/4 05/19/26	1'000	0	0	1'000 USD	93.78%	825'507.25	0.10	a)
US44891CDC47	5.3000 % HYNMTR 5.3 06/24/29 REGS	0	3'000	0	3'000 USD	101.32%	2'675'475.86	0.33	a)
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	4'000	0	2'000	2'000 USD	99.55%	1'752'542.54	0.21	a)
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	0	3'050	0	3'050 USD	101.33%	2'720'550.38	0.33	a)
US4581X0DN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	900	0	0	900 USD	96.15%	761'700.57	0.09	a)
US4581X0DQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	2'000	0	0	2'000 USD	89.82%	1'581'333.92	0.19	a)
US4581X0EF19	3.5000 % IADB 3 1/2 09/14/29	2'100	0	0	2'100 USD	97.55%	1'803'180.68	0.22	a)
US4581X0EH74	4.0000 % IADB 4 01/12/28	2'000	0	0	2'000 USD	99.68%	1'754'848.80	0.21	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	3'400	0	0	3'400 USD	95.20%	2'849'133.34	0.35	a)
US4581X0EN43	4.1250 % IADB 4 1/8 02/15/29	6'350	0	0	6'350 USD	100.43%	5'613'734.52	0.68	a)
US459058JE46	0.3750 % IBRD 0 3/8 07/28/25	2'000	0	0	2'000 USD	95.79%	1'686'400.56	0.21	a)
US459058JL88	0.5000 % IBRD 0 1/2 10/28/25	1'500	0	0	1'500 USD	95.09%	1'255'571.00	0.15	a)
US459058JX27	0.8750 % IBRD 0 7/8 07/15/26	2'300	0	0	2'300 USD	93.60%	1'895'002.20	0.23	a)
US459058JZ74	1.1250 % IBRD 1 1/8 09/13/28	1'600	0	0	1'600 USD	89.02%	1'253'687.26	0.15	a)
US459058KL69	3.6250 % IBRD 3 5/8 09/21/29	1'800	0	0	1'800 USD	98.15%	1'555'105.99	0.19	a)
US45905URL07	2.1250 % IBRD 2 1/8 03/03/25 GDIF	2'500	0	0	2'500 USD	98.33%	2'163'874.56	0.26	a)
US45906M5K36	4.7500 % IBRD 4 3/4 07/30/29 GDIF	0	7'000	0	7'000 USD	100.30%	6'180'235.25	0.75	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	0	6'000	3'000	3'000 USD	87.09%	2'299'829.18	0.28	a)
US49271VAT70	5.0500 % KDP 5.05 03/15/29	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	2'600	0	0	2'600 USD	101.71%	2'327'785.92	0.28	a)
US500769JU96	3.1250 % KFW 3 1/8 06/10/25	2'000	0	0	2'000 USD	98.53%	1'734'585.44	0.21	a)
US500769JW52	3.7500 % KFW 3 3/4 02/15/28	1'300	0	0	1'300 USD	98.93%	1'132'023.51	0.14	a)
US50249AAJ25	3.6250 % LYB 3 5/8 04/01/51	2'000	0	0	2'000 USD	70.60%	1'242'913.00	0.15	a)
US53944YBA01	5.7210 % LLOYDS 5.721 06/05/30	0	3'650	0	3'650 USD	102.81%	3'303'195.34	0.40	a)
US563469UY98	1.5000 % MP 1 1/2 10/25/28 HB	2'500	0	0	2'500 USD	89.62%	1'972'156.11	0.24	a)
US57629W4564	5.1000 % MASSMU 5.1 04/09/27 144A	0	3'600	600	3'000 USD	101.36%	2'676'637.79	0.33	a)
US58989V2H68	5.2500 % MET 5 1/4 04/12/29 144A	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GEZ81	3.3000 % MET 3.3 03/21/29 144A	3'000	0	0	3'000 USD	94.32%	2'490'676.18	0.30	a)
US61690U7W40	5.8820 % MS 5.882 10/30/26 BKNT	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61690U8E33	4.9680 % MS 4.968 07/14/28 BKNT	0	500	0	500 USD	100.36%	441'700.65	0.05	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	1'800	0	0	1'800 USD	94.34%	1'494'754.29	0.18	a)
US63861WAK18	5.1270 % NWDI 5.127 07/29/29 REGS	0	4'300	0	4'300 USD	101.13%	3'827'884.20	0.47	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	500	0	0	500 USD	93.80%	412'828.45	0.05	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	5'000	0	1'000	4'000 USD	100.92%	3'553'252.36	0.43	a)
US65163LAN91	5.3000 % NEM 5.3 03/15/26 144A	0	2'100	0	2'100 USD	100.54%	1'858'562.49	0.23	a)
US65559D2E87	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 REGS	2'800	0	0	2'800 USD	93.06%	2'293'600.53	0.28	a)
US67077MAW82	2.9500 % NTRCN 2.95 05/13/30	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US676167CB35	0.3750 % OKB 0 3/8 09/17/25	1'500	0	0	1'500 USD	95.26%	1'257'776.02	0.15	a)
US676167CG22	4.6250 % OKB 4 5/8 11/03/25	1'300	0	0	1'300 USD	99.96%	1'143'855.83	0.14	a)
US683234AQ19	1.0500 % ONT 1.05 05/21/27	2'300	0	0	2'300 USD	91.59%	1'854'247.51	0.23	a)
US683234AU21	2.1250 % ONT 2 1/8 01/21/32 MTN	1'950	0	0	1'950 USD	86.32%	1'481'706.34	0.18	a)
US68329AAH14	1.2500 % ONTFFT 1 1/4 09/27/30 144A	2'000	0	0	2'000 USD	83.52%	1'470'299.18	0.18	a)
US69376Q2A05	0.5000 % PSCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.39%	874'871.67	0.11	a)
US69376Q2B87	1.6250 % PSCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	89.96%	1'583'781.01	0.19	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	2'800	0	0	2'800 USD	94.32%	2'324'680.39	0.28	a)
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	1'000	0	0	1'000 USD	85.23%	750'237.08	0.09	a)
US748148SD69	3.6250 % Q 3 5/8 04/13/28	3'100	0	0	3'100 USD	97.99%	2'673'953.91	0.33	a)
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	1'500	0	0	1'500 USD	99.46%	1'313'231.77	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US749775DJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	95.38%	1'679'112.09	0.20	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	1'000	0	0	1'000 USD	94.01%	827'496.62	0.10	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	100.89%	888'040.21	0.11	a)
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	101.29%	891'605.23	0.11	a)
US78016HZW32	5.1500 % RY 5.15 02/01/34 GMTN	1'785	0	785	1'000 USD	101.58%	894'175.56	0.11	a)
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	3'500	0	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	3'000	0	0	3'000 USD	101.64%	2'683'952.67	0.33	a)
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	1'850	0	0	1'850 USD	103.44%	1'684'400.19	0.21	a)
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	3'000	0	0	3'000 USD	91.81%	2'424'551.80	0.30	a)
US87264ADF93	5.1500 % TMUS 5.15 04/15/34	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060BD74	3.3750 % TACHEM 3 3/8 07/09/60	2'000	0	0	2'000 USD	65.60%	1'154'888.00	0.14	a)
US874060BL90	5.6500 % TACHEM 5.65 07/05/44	0	9'000	6'000	3'000 USD	100.23%	2'646'876.54	0.32	a)
US912796ZW23	0.0000 % B 06/20/24	0	9'000	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797HQ30	0.0000 % B 05/09/24	0	10'000	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	8'000	0	0	8'000 USD	84.75%	5'968'095.00	0.73	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	10'000	0	0	10'000 USD	79.41%	6'989'735.16	0.85	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	8'500	2'500	0	11'000 USD	80.09%	7'755'277.58	0.95	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	17'500	1'500	0	19'000 USD	68.02%	11'375'443.24	1.39	a)
US912810TP30	1.5000 % TII 1 1/2 02/15/53	7'000	0	0	7'000 USD	91.91%	5'663'148.37	0.69	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	21'000	0	21'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	10'000	6'000	11'000	5'000 USD	89.34%	3'932'241.80	0.48	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	5'000	0	0	5'000 USD	99.32%	4'371'335.28	0.53	a)
US91282CXC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	5'000	16'000	21'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PFL13	5.6250 % UNH 5 5/8 07/15/54	0	3'550	0	3'550 USD	102.56%	3'204'978.37	0.39	a)
US91324PFM95	5.7500 % UNH 5 3/4 07/15/64	0	1'200	0	1'200 USD	102.72%	1'085'020.80	0.13	a)
US94988J6D46	5.4500 % WFC 5.45 08/07/26 BKNT	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2S19	2.3930 % WFC 2.393 06/02/28 MTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	2'500	0	0	2'500 USD	90.00%	1'980'540.49	0.24	a)
USC23264AX96	4.8750 % CADEPO 4 7/8 06/05/29 REGS	0	3'100	0	3'100 USD	102.78%	2'804'716.81	0.34	a)
USC68012AA85	2.5000 % OMERFT 2 1/2 05/02/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	3'200	0	0	3'200 USD	106.35%	2'995'694.97	0.37	a)
USF0803NAC68	4.5240 % BFCM 4.524 07/13/25 REGS	1'980	0	0	1'980 USD	99.39%	1'732'298.20	0.21	a)
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	2'450	0	2'450 USD	101.43%	2'187'495.19	0.27	a)
USF11494CF05	5.9360 % BPCEGP 5.936 05/30/35 REGS	0	1'300	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	92.40%	1'220'013.30	0.15	a)
USG6398ADD66	5.2640 % NWDIE 5.264 11/10/26 REGS	3'100	0	0	3'100 USD	101.52%	2'770'225.09	0.34	a)
USG84228GC69	6.0970 % STANLN 6.097 01/11/35 REGS	2'550	0	0	2'550 USD	104.29%	2'340'865.11	0.29	a)
USH42097CT27	2.7460 % UBS 2.746 02/11/33 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	84.03%	1'109'497.91	0.14	a)
USJ5539RAM64	5.1100 % NTT 5.11 07/02/29 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	101.61%	1'788'914.47	0.22	a)
USJ5539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	0	3'000	0	3'000 USD	101.64%	2'684'031.89	0.33	a)
USP2205JAT71	5.9500 % CENSUD 5.95 05/28/31 REGS	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP8718AAP14	6.5000 % SQM 6 1/2 11/07/33 REGS	1'350	0	0	1'350 USD	104.57%	1'242'680.17	0.15	a)
USU74078CK74	1.1500 % NESNVX 1.15 01/14/27 REGS	0	3'000	0	3'000 USD	92.19%	2'434'613.06	0.30	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	1'400	0	0	1'400 USD	106.23%	1'309'113.08	0.16	a)
USU8344PAE98	5.6500 % SYENS 5.65 06/04/29 REGS	0	3'200	700	2'500 USD	102.44%	2'254'386.27	0.27	a)
USU8344PAF63	5.8500 % SYENS 5.85 06/04/34 REGS	0	4'000	1'000	3'000 USD	102.56%	2'708'353.20	0.33	a)
USY06072AH89	5.6500 % BBLTB 5.65 07/05/34 REGS	0	2'400	0	2'400 USD	103.02%	2'176'400.52	0.27	a)
USY3815NBG52	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	100.24%	1'764'672.39	0.22	a)
USY3815NBH36	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/29 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY4938AAJ89	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/27 REGS	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY4938AAL36	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/29 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY555CGAL65	5.3750 % LGENSO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	2'800	0	2'800 USD	101.04%	2'490'209.65	0.30	a)
X51795323952	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 06/01/48	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REGS	850	0	0	850 USD	96.72%	723'671.13	0.09	a)
XS2182093943	1.0000 % BNG 1 06/03/30 REGS	0	7'500	2'500	5'000 USD	83.59%	3'679'004.88	0.45	a)
XS2224639802	0.6250 % JFM 0 5/8 09/02/25 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	95.41%	1'679'640.24	0.20	a)
XS2233188353	1.6250 % QNBK 1 5/8 09/22/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	95.84%	1'687'227.99	0.21	a)
XS2233264550	0.3750 % CADES 0 3/8 09/23/25 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	95.12%	1'339'656.00	0.16	a)
XS2270152098	0.5000 % LBANK 0 1/2 12/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100 USD	94.61%	2'581'694.03	0.31	a)
XS2280635256	1.6380 % EBIUH 1.638 01/13/26	3'000	0	0	3'000 USD	94.88%	2'505'517.19	0.31	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2297244878	0.6250 % IDBINV 0 5/8 02/10/26 EMTN	2'800	0	0	2'800 USD	94.07%	2'318'592.58	0.28	a)
XS2333299324	1.0000 % IFIM 1 04/21/26 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	94.06%	1'241'984.34	0.15	a)
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	94.17%	1'160'540.97	0.14	a)
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	94.22%	1'658'795.92	0.20	a)
XS2348714713	3.1270 % UCGIM 3.127 06/03/32 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	86.74%	1'145'280.07	0.14	a)
XS2396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 USD	89.39%	1'337'714.16	0.16	a)
XS2402074277	1.2500 % CADES 1 1/4 10/28/26 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	93.34%	2'054'151.40	0.25	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	93.88%	1'322'220.00	0.16	a)
XS2481608029	3.0000 % RENTEN 3 05/21/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	95.36%	1'259'122.80	0.15	a)
XS2580013386	4.3750 % FABUH 4 3/8 04/24/28 EMTN	2'200	0	0	2'200 USD	98.27%	1'903'067.05	0.23	a)
XS2613192926	4.1250 % JFM 4 1/8 04/27/28 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	98.89%	1'305'771.65	0.16	a)
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	1'400	0	0	1'400 USD	100.38%	1'237'032.93	0.15	a)
XS2654057970	5.3750 % COMQAT 5 3/8 03/28/29 EMTN	0	3'750	0	3'750 USD	100.23%	3'308'562.67	0.40	a)
XS2725962398	7.2000 % ISPIM 7.2 11/28/33 REGS	0	2'000	500	1'500 USD	110.03%	1'452'808.61	0.18	a)
XS2775400703	5.5000 % SHINCA 5 1/2 03/12/29	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2811681779	5.5000 % ENIIM 5 1/2 05/15/34 REGS	0	1'900	0	1'900 USD	101.96%	1'705'205.34	0.21	a)
XS2811682587	5.9500 % ENIIM 5.95 05/15/54 REGS	0	1'200	0	1'200 USD	101.28%	1'069'767.83	0.13	a)
XS2830445727	5.2940 % MUBAUH 5.294 06/04/34 GMTN	0	2'800	0	2'800 USD	101.88%	2'510'962.42	0.31	a)
XS2851607403	5.7500 % BGOSK 5 3/4 07/09/34 REGS	0	4'200	2'200	2'000 USD	103.50%	1'822'135.11	0.22	a)
XS2851609102	6.2500 % BGOSK 6 1/4 07/09/54 REGS	0	2'000	1'000	1'000 USD	104.82%	922'660.45	0.11	a)
XS2865538776	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/29 EMTN	0	4'450	0	4'450 USD	99.18%	3'885'109.69	0.47	a)
<b>USD</b>							<b>325'539'701.40</b>	<b>39.71</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>38'051'529.77</b>	<b>4.64</b>	
IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	10'477'252	0	0	10'477'252 USD	4.13	38'051'529.77	4.64	a)
<b>USD</b>							<b>38'051'529.77</b>	<b>4.64</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>1'335'390.73</b>	<b>0.16</b>	
<b>Optionen und Optionsscheine</b>							<b>110'031.25</b>	<b>0.01</b>	
TUN4C 102.25	US 2YR FUTR OPTN JUL24C102.25	0	1	1	0 USD	0.00	0.00	0.00	
TUN4C 102.75	US 2YR FUTR OPTN JUL24C102.75	0	1	1	0 USD	0.00	0.00	0.00	
TUQ4C 102.375	US 2YR FUTR OPTN AUG24C102.38	0	1	1	0 USD	0.00	0.00	0.00	
TUQ4C 102.875	US 2YR FUTR OPTN AUG24C102.88	0	1	1	0 USD	0.00	0.00	0.00	
TYQ4C 110.25	US 10YR FUT OPTN AUG24C110.25	0	0	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
TUU4C 102.75	US 2YR FUTR OPTN SEP24C102.75	0	1	0	1 USD	0.18	158'170.36	0.02	a)
TUU4C 103.25	US 2YR FUTR OPTN SEP24C103.25	0	0	1	-1 USD	0.05	-48'139.11	-0.01	a)
<b>Futures</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	-130	225	95	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	30	90	120	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-SCHATZ FUT MAR24	10	0	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	-40	40	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR NOTE (CBT)MAR24	90	0	90	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US ULTRA BOND CBT MAR24	80	0	80	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	90	0	90	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 5YR NOTE (CBT) MAR24	380	440	820	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 2YR NOTE (CBT) MAR24	-50	50	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	315	315	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	225	225	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-SCHATZ FUT JUN24	0	10	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	90	90	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 10YR NOTE (CBT)JUN24	0	8	8	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US LONG BOND(CBT) JUN24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 10YR ULTRA FUT JUN24	0	75	75	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US ULTRA BOND CBT JUN24	0	78	78	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 5YR NOTE (CBT) JUN24	0	695	695	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 2YR NOTE (CBT) JUN24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUND FUTURE SEP24	0	160	375	-215 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	EURO-BOBL FUTURE SEP24	0	45	50	-5 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	EURO-SCHATZ FUT SEP24	0	10	0	10 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	EURO-BUXL 30Y BND SEP24	0	40	0	40 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	EURO-OAT FUTURE SEP24	0	100	99	1 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US 10YR NOTE (CBT)SEP24	0	315	170	145 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US LONG BOND(CBT) SEP24	0	85	75	10 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US 10YR ULTRA FUT SEP24	0	10	15	-5 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US ULTRA BOND CBT SEP24	0	180	50	130 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	LONG GILT FUTURE SEP24	0	85	65	20 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US 5YR NOTE (CBT) SEP24	0	369	349	20 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US 2YR NOTE (CBT) SEP24	0	45	50	-5 USD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

CHF/CAD	Verfall 07.03.2024		3'400'000	2'157'579		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 07.03.2024		97'600'000	11'634'896		CNY/CHF	0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 07.03.2024		2'914'670	2'300'000		USD/GBP	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.03.2024		1'275'000'000	7'517'145		JPY/CHF	0.00	0.00	
EUR/JPY	Verfall 07.03.2024		2'402'080'900	15'146'761		JPY/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.03.2024		5'800'000	4'960'723		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 07.03.2024		4'800'000	5'201'386		GBP/CHF	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 07.03.2024		3'700'000	3'383'677		USD/EUR	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 07.03.2024		1'461'010	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 07.03.2024		28'600'000	1'078'838		CZK/CHF	0.00	0.00	
CNY/EUR	Verfall 07.03.2024		221'731	1'739'262		EUR/CNY	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 07.03.2024		56'654	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.03.2024		44'317'294	47'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.03.2024		3'100'000	2'650'274		USD/CHF	0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 07.03.2024		3'400'000	2'675'838		USD/GBP	0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 07.03.2024		1'117'162	1'500'000		USD/CAD	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.03.2024		367'800'000	2'172'013		JPY/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.03.2024		500'000	566'896		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.03.2024		500'000	542'372		EUR/USD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 07.03.2024		11'939'506	97'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 07.03.2024		1'078'932	28'600'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 07.03.2024		1'500'000	1'105'308		CAD/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.03.2024		9'638'423	1'642'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 07.03.2024		2'210'092	3'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 07.03.2024		100'000	57'488		AUD/CHF	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.03.2024		5'365'608	4'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CNY	Verfall 07.03.2024		1'733'808	221'731		CNY/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.03.2024		3'411'638	3'700'000		EUR/USD	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 07.03.2024		47'400'000	45'356'444		EUR/CHF	0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.03.2024		4'983'726	6'314'670		GBP/USD	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 07.03.2024		29'200'000	1'514'773		MXN/CHF	0.00	0.00	
JPY/EUR	Verfall 07.03.2024		14'730'322	2'402'080'900		EUR/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.03.2024		7'851'277	8'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 08.03.2024		54'992'300'000	3'017'294		IDR/CHF	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 08.03.2024		7'699'400'000	4'950'428		KRW/CHF	0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 08.03.2024		3'081'008	54'992'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 08.03.2024		5'100'251	7'699'400'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 12.06.2024		97'600'000	11'892'658		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 12.06.2024		28'600'000	1'067'727		CZK/CHF	0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 12.06.2024		1'106'855	1'500'000		USD/CAD	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.06.2024		1'642'800'000	9'682'285		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 12.06.2024		3'400'000	2'190'375		CAD/CHF	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 12.06.2024		57'053	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 12.06.2024		4'800'000	5'312'856		GBP/CHF	0.00	0.00	
CNY/EUR	Verfall 12.06.2024		221'731	1'729'843		EUR/CNY	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 12.06.2024		3'700'000	3'398'271		USD/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 12.06.2024		45'061'663	47'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/USD Verfall 12.06.2024		6'314'670	4'981'053		USD/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 12.06.2024		1'476'329	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 12.06.2024		2'402'080'900	14'893'726		JPY/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.06.2024		8'900'000	7'770'056		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/GBP Verfall 12.06.2024		3'454'777	4'400'000		GBP/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.06.2024		311'300'000	1'862'776		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.06.2024		4'609'945	5'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.06.2024		1'150'900'000	6'911'500		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.06.2024		1'548'036	2'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.06.2024		953'438	1'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/JPY Verfall 12.06.2024		390'037'680	3'600'000		JPY/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.06.2024		2'619'847	440'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/GBP Verfall 12.06.2024		4'096'982	5'200'000		GBP/USD	0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 12.06.2024		1'600'000	1'373'894		EUR/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.06.2024		7'729'417	7'000'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.06.2024		2'730'487	2'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.06.2024		3'476'605	596'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/JPY Verfall 12.06.2024		13'000'000	1'455'109		JPY/MXN	0.00	0.00	
	USD/CAD Verfall 12.06.2024		1'500'000	1'096'608		CAD/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.06.2024		10'105'511	11'329'417		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 12.06.2024		3'400'376	3'700'000		EUR/USD	0.00	0.00	
	GBP/USD Verfall 12.06.2024		3'285'330	2'567'583		USD/GBP	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 12.06.2024		1'360'624	1'600'000		GBP/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.06.2024		51'200'000	49'694'771		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 12.06.2024		14'141'001	2'402'080'900		EUR/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CNY Verfall 12.06.2024		1'751'553	221'731		CNY/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.06.2024		651'928	1'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 12.06.2024		29'200'000	1'491'025		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.06.2024		11'989'672	97'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.06.2024		100'000	59'368		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.06.2024		11'814'409	2'067'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CAD Verfall 12.06.2024		3'600'000	410'803'200		CAD/JPY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 12.06.2024		1'126'051	28'600'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.06.2024		5'477'126	4'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 13.06.2024		54'992'300'000	3'047'205		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 13.06.2024		7'699'400'000	5'075'419		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 13.06.2024		5'027'664	7'699'400'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 13.06.2024		3'009'747	54'992'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 17.06.2024		1'000'000	1'187'279		GBP/EUR	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 01.07.2024		2'000'000	2'148'230		EUR/USD	0.00	0.00	
	CAD/USD Verfall 11.09.2024		1'098'840	1'500'000		USD/CAD	10'290.44	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 11.09.2024		11'329'417	10'001'813		USD/CHF	-77'069.65	-0.01	b)
	EUR/USD Verfall 11.09.2024		3'700'000	3'386'095		USD/EUR	25'230.76	0.00	b)
	USD/GBP Verfall 11.09.2024		2'566'311	3'285'330		GBP/USD	10'478.27	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 11.09.2024		49'391'155	51'200'000		CHF/EUR	762'713.77	0.09	b)
	GBP/EUR Verfall 11.09.2024		1'600'000	1'365'706		EUR/GBP	-17'513.23	0.00	b)
	EUR/JPY Verfall 11.09.2024		2'402'080'900	14'275'812		JPY/EUR	511'068.05	0.06	b)
	CNY/EUR Verfall 11.09.2024		221'731	1'747'234		EUR/CNY	-1'887.35	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 11.09.2024		1'000'000	646'575		CAD/CHF	-11'701.69	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 11.09.2024		1'454'759	29'200'000		CHF/MXN	90'194.28	0.01	b)
	CHF/CNY Verfall 11.09.2024		97'600'000	11'948'582		CNY/CHF	-79'409.13	-0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 11.09.2024		58'908	100'000		CHF/AUD	1'642.89	0.00	b)
	CAD/JPY Verfall 11.09.2024		406'035'360	3'600'000		JPY/CAD	92'753.45	0.01	b)
	CHF/JPY Verfall 11.09.2024		2'067'900'000	11'854'319		JPY/CHF	258'125.45	0.03	b)
	CHF/CZK Verfall 11.09.2024		28'600'000	1'116'212		CZK/CHF	-50'330.32	-0.01	b)
	CHF/GBP Verfall 11.09.2024		4'800'000	5'423'525		GBP/CHF	-20'949.41	0.00	b)
	USD/JPY Verfall 11.09.2024		230'900'000	1'522'560		JPY/USD	18'706.56	0.00	b)
	EUR/NOK Verfall 11.09.2024		25'200'000	2'093'697		NOK/EUR	32'419.61	0.00	b)
	EUR/NOK Verfall 11.09.2024		30'500'000	2'535'244		NOK/EUR	38'093.21	0.00	b)
	USD/EUR Verfall 11.09.2024		7'365'560	8'000'000		EUR/USD	-12'559.76	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 12.09.2024		7'699'400'000	5'003'808		KRW/CHF	-92'762.59	-0.01	b)
	CHF/IDR Verfall 12.09.2024		54'992'300'000	2'976'193		IDR/CHF	-18'543.97	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>1'468'989.64</b>	<b>0.18</b>	

## Swaps

01/29	IRS FIX LEG 3.75097% P.A. GBP	15'000	0	0	15'000	GBP	98.93%	16'778'412.29	2.05	b)
01/29	IRS FLOATING LEG - GBP - SONIO/N	-15'000	0	0	-15'000	GBP	100.00	-16'959'556.65	-2.07	b)
03/54	IRS FIX LEG 2.3812% P.A. EUR	0	0	10'000	-10'000	EUR	99.83%	-9'509'128.07	-1.16	b)
03/54	IRS FLOATING LEG - EUR - ESTRON	0	10'000	0	10'000	EUR	100.00	9'525'175.00	1.16	b)
07/54	IRS FIX LEG 3.63195% P.A. USD	0	0	7'000	-7'000	USD	101.27%	-6'240'282.73	-0.76	b)
								<b>-243'630.16</b>	<b>-0.03</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
07/54	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	7'000	0	7'000 USD	100.00	6'161'750.00	0.75	b)

### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	11'381'834.04	1.39
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	762'219'672.43	92.98
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	38'051'529.77	4.64
Derivative Finanzinstrumente	1'335'390.73	0.16
Sonstige Vermögenswerte	6'796'535.10	0.83
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>819'784'962.07</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-82'224.15	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>819'702'737.92</b>	

### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	800'381'233.45	97.63
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	1'225'359.48	0.15
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57480325
CAD	1 = CHF	0.63719280
CNY	1 = CHF	0.12179008
COP	1'000 = CHF	0.21686000
CZK	100 = CHF	3.74050000
DKK	100 = CHF	12.76483100
EUR	1 = CHF	0.95251750
GBP	1 = CHF	1.13063711
IDR	10'000 = CHF	0.54140000
JPY	100 = CHF	0.58503900
KRW	1 = CHF	0.00063937
MXN	1 = CHF	0.04724779
MYR	1 = CHF	0.19158777
NOK	100 = CHF	8.05020800
NZD	1 = CHF	0.52282449
PLN	1 = CHF	0.22181204
SEK	100 = CHF	8.21312600
SGD	1 = CHF	0.65808164
THB	100 = CHF	2.46949100
USD	1 = CHF	0.88025000
ZAR	1 = CHF	0.04838865

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten	CHF	368'158'134.55	44.914
Netto-Gesamtingagement aus Derivaten	CHF	157'850'114.60	19.257
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DA CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	0.950	1.200	0.750	0.200	4.000
BA CHF	0.580	0.900	0.380	0.200	4.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	4.000
DA CHF	0.450	0.700	0.350	0.100	4.000
GT CHF	0.380	0.600	0.280	0.100	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

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

## 8 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

## 9 TER

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

## 10 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert des Anlagefonds und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurück-genommen werden, in der Rechnungseinheit des Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Anlagefonds gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar 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 auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Anlagefonds führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Anlagefonds bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger



im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
  - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen, getätigt wurden.