

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL RATES

## Halbjahresbericht per 30.04.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Investment Fund I  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	41253666	CHF
CT CHF	41253667	CHF
NT CHF	3009873	CHF
NT USD	125531425	USD
NTH1 CHF	49241069	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	Collateral ausgeliehene Effekten	20
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	20
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	21
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	21
8	Pauschale Verwaltungskommission	22
9	Benchmark	22
10	TER	22
11	Fussnoten	23
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	24

# 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	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	30.04.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		571'854'102.84	499'908'675.74	360'139'579.40	425'116'466.88
<b>Klasse AA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		31'395'548.31	32'362'439.83	41'161'222.89	56'869'758.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		401'116.470	429'090.159	493'320.812	573'164.927
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		78.2704	75.4211	83.4370	99.2206
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		78.3017	75.4512	83.4370	99.2702
Ausschüttung je Anteil		-	0.10	0.15	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
<b>Klasse CT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'788'581.54	15'968'691.77	20'067'069.68	27'588'771.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		180'028.240	202'061.142	230'600.732	268'867.916
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.1459	79.0290	87.0208	102.6109
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		82.1788	79.0606	87.0208	102.6622
Thesaurierung je Anteil		-	0.45	0.43	1.27
Total Expense Ratio (TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		171'844'413.00	177'376'234.98	120'578'093.61	208'682'159.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		145'146.681	155'832.278	96'489.200	142'066.990
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'183.9362	1'138.2509	1'249.6538	1'468.8997
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'184.4098	1'138.7062	1'249.6538	1'469.6342
Thesaurierung je Anteil		-	12.50	12.90	25.58
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse NT USD</b>					
	<b>USD</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		13'336'891.27	12'974'305.02		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		152'297.343	154'239.560		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.4821	92.4322		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.5203	92.4691		
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		-	0.70		
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %		
<b>Klasse NTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		340'488'668.72	261'227'004.14	178'333'193.22	131'975'778.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'054'294.224	3'175'843.948	2'080'435.249	1'341'135.464
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.9822	82.2544	85.7192	98.4060
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		84.0158	82.2873	85.7192	98.4552
Thesaurierung je Anteil		-	0.89	0.86	1.71
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

## Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	3.91 %	-6.09 %	-16.47 %	-2.69 %
Klasse CT CHF	4.15 %	-5.66 %	-16.09 %	-2.25 %
Klasse NT CHF	4.41 %	-5.09 %	-15.74 %	-1.76 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	3.60 %	1.46 %	-	-
Klasse NTH1 CHF	2.48 %	1.88 %	-12.77 %	-3.07 %
Benchmark Hedge	2.18 %	2.16 %	13.39 %	-
Benchmark	4.13 %	-5.23 %	-16.47 %	-2.44 %
Tracking Error 33)	-	0.35 %	0.65 %	0.53 %

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

## Tracking Differenz

### Klasse

Klasse AA CHF	-0.22 %
Klasse CT CHF	0.02 %
Klasse NT CHF	0.28 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	-0.53 %
Klasse NTH1 CHF	0.30 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.04.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	6'297'325.49	13'436'822.36
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	597'636'883.22	528'371'785.30
Derivative Finanzinstrumente	-970'605.84	-1'972'510.85
Sonstige Vermögenswerte	3'847'068.11	2'863'606.13
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>606'810'670.98</b>	<b>542'699'702.94</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-34'922'684.31	-42'757'008.38
Andere Verbindlichkeiten	-33'883.83	-34'018.82
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>571'854'102.84</b>	<b>499'908'675.74</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
<b>Klasse AA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		429'090.159	493'320.812
Ausgegebene Anteile		2'541.146	3'219.711
Zurückgenommene Anteile		-30'514.835	-67'450.364
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>401'116.470</b>	<b>429'090.159</b>

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
<b>Klasse CT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		202'061.142	230'600.732
Ausgegebene Anteile		2'093.502	1'752.811
Zurückgenommene Anteile		-24'126.404	-30'292.401
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>180'028.240</b>	<b>202'061.142</b>

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		155'832.278	96'489.200
Ausgegebene Anteile		26'147.914	83'991.805
Zurückgenommene Anteile		-36'833.511	-24'648.727
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>145'146.681</b>	<b>155'832.278</b>

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 27.03.2023 31.10.2023
<b>Klasse NT USD</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		154'239.560	-
Ausgegebene Anteile		17'262.343	154'339.560
Zurückgenommene Anteile		-19'204.560	-100.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>152'297.343</b>	<b>154'239.560</b>

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
<b>Klasse NTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'175'843.948	2'080'435.249
Ausgegebene Anteile		1'750'260.390	1'942'490.559
Zurückgenommene Anteile		-871'810.114	-847'081.860
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>4'054'294.224</b>	<b>3'175'843.948</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		499'908'675.74	360'139'579.40
Ausbezahlte Ausschüttung		-42'008.42	-71'592.40
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'858'186.60	-1'276'146.46
Saldo aus dem Anteilverkehr		56'954'238.20	168'697'998.87
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		16'891'383.92	-27'581'163.67
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>571'854'102.84</b>	<b>499'908'675.74</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.11.2023 30.04.2024</b>	<b>01.11.2022 31.10.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		38'660.60	77'151.67
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'668.79	-19'203.46
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'723'507.71	4'486'578.42
Erträge aus Wertpapierleihe		43'245.30	77'174.24
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		578'774.17	1'264'191.02
<b>Total Ertrag</b>		<b>5'382'518.99</b>	<b>5'885'891.89</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-3.11	0.00
Reglementarische Vergütungen		-190'547.92	-442'597.71
Sonstige Aufwendungen		-252.00	-504.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-460'865.64	-424'936.08
<b>Total Aufwand</b>		<b>-651'668.67</b>	<b>-868'037.79</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>4'730'850.32</b>	<b>5'017'854.10</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-20'206'554.00	-16'803'003.48
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		82'566.75	186'975.26
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-15'393'136.93</b>	<b>-11'598'174.12</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		32'284'520.85	-15'982'989.55
<b>Gesamterfolg</b>		<b>16'891'383.92</b>	<b>-27'581'163.67</b>



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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>597'636'883.22</b>	<b>98.49</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>597'636'883.22</b>	<b>98.49</b>	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.24%	1'254'909.65	0.21	a)
<b>AE</b>							<b>1'254'909.65</b>	<b>0.21</b>	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	4'000	0	1'000	3'000 AUD	77.57%	1'385'979.01	0.23	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	2'800	2'400	2'500	2'700 AUD	97.85%	1'573'481.21	0.26	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'100	0	0	1'100 AUD	54.47%	356'856.16	0.06	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	1'250	1'250	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	0	2'750	750	2'000 AUD	81.42%	969'819.64	0.16	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	5'500	0	0	5'500 AUD	71.30%	2'335'356.35	0.38	a)
USQ97417FA49	1.5520 % WSTP 1.552 09/30/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	91.50%	1'678'347.81	0.28	a)
XS2673140633	3.7680 % CBAAU 3.768 08/31/27	4'000	0	0	4'000 EUR	100.95%	3'959'740.69	0.65	a)
<b>AU</b>							<b>12'259'580.87</b>	<b>2.02</b>	
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	4'500	4'500	4'000	5'000 EUR	62.28%	3'053'701.65	0.50	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	0	12'000	0	12'000 EUR	97.70%	11'497'232.31	1.89	a)
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	5'750	0	5'750 USD	95.65%	5'044'368.56	0.83	a)
<b>BE</b>							<b>19'595'302.52</b>	<b>3.23</b>	
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	1'750	0	0	1'750 CAD	70.25%	820'725.25	0.14	a)
CA110709GL02	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/32	2'000	500	0	2'500 CAD	91.66%	1'529'701.53	0.25	a)
CA12593ZAA80	3.9500 % CPPIBC 3.95 06/02/32	4'000	0	0	4'000 CAD	96.68%	2'581'732.03	0.43	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	2'100	0	2'100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N423	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/24	1'800	0	1'800	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	4'750	2'250	0	7'000 CAD	86.95%	4'063'017.57	0.67	a)
US22411WAR79	0.5000 % CPPIBC 0 1/2 09/16/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US302168KB70	4.3750 % EDC 4 3/8 06/29/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US891160TD51	4.7010 % TD 4.701 06/05/26 144A	0	5'000	0	5'000 USD	98.64%	4'523'521.37	0.75	a)
USC23264AF80	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	99.45%	2'280'264.19	0.38	a)
USC23264AK75	0.8750 % CADEPO 0 7/8 06/10/25 REGS	0	2'500	0	2'500 USD	95.14%	2'181'326.63	0.36	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	5'500	0	2'000	3'500 USD	91.32%	2'931'298.53	0.48	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	101.35%	3'718'272.84	0.61	a)
USC7976PAK24	4.8510 % RY 4.851 12/14/26 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	98.75%	4'528'290.55	0.75	a)
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2250201329	0.0000 % Q 0 10/29/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	81.40%	3'991'269.16	0.66	a)
XS2305736543	0.0500 % CPPIBC 0.05 02/24/31 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	80.82%	1'981'463.93	0.33	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTFT 0.95 11/24/51 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	53.68%	1'052'903.85	0.17	a)
XS2448412879	0.5000 % EDC 0 1/2 02/25/27 EMTN	2'000	3'000	3'000	2'000 EUR	92.75%	1'819'099.65	0.30	a)
XS2475513953	1.8500 % ONTFT 1.85 05/03/32 REGS	4'000	0	0	4'000 EUR	88.90%	3'487'176.46	0.57	a)
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	1'500	1'500	0	3'000 GBP	100.71%	3'469'723.68	0.57	a)
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	7'000	0	0	7'000 EUR	102.40%	7'029'358.57	1.16	a)
<b>CA</b>							<b>51'989'145.79</b>	<b>8.57</b>	
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	2'500	0	2'500 CHF	99.21%	2'480'250.00	0.41	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	750	1'000	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	0	1'000	0	1'000 CHF	99.83%	998'300.00	0.16	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	750	250	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	1'000	1'250	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	0	1'000	750	250 CHF	88.20%	220'500.00	0.04	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	1'450	1'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>CH</b>							<b>3'699'050.00</b>	<b>0.61</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND100002BR5	4.0800 % CGB 4.08 03/01/40 1003	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100008593	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	20'000	0	0	20'000 CNY	105.92%	2'678'683.30	0.44	a)
CND100037XX3	2.8500 % CGB 2.85 06/04/27 INBK	29'000	0	29'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	10'000	0	0	10'000 CNY	128.16%	1'620'634.12	0.27	a)
CND100045MS9	3.7200 % CGB 3.72 04/12/51 INBK	30'000	0	0	30'000 CNY	120.72%	4'579'623.57	0.75	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	20'000	0	0	20'000 CNY	103.72%	2'623'170.87	0.43	a)
CND10004R114	2.3700 % CGB 2.37 01/20/27 INBK	35'000	5'000	40'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100054BH7	2.7500 % CGB 2.3/4 06/15/29 INBK	33'000	7'000	0	40'000 CNY	102.54%	5'186'504.65	0.85	a)
CND10005TZQ1	2.8000 % CGB 2.8 11/15/32 INBK	40'000	0	0	40'000 CNY	103.27%	5'223'681.54	0.86	a)
CND100067578	2.8000 % CGB 2.8 03/25/30 INBK	65'000	15'000	0	80'000 CNY	102.85%	10'404'875.21	1.71	a)
CND100069PK9	3.1900 % CGB 3.19 04/15/53 INBK	15'000	10'000	0	25'000 CNY	112.70%	3'562'911.55	0.59	a)
CND100076348	2.6700 % CGB 2.67 11/25/33 INBK	0	35'000	0	35'000 CNY	102.71%	4'545'892.50	0.75	a)
CND10007C3M6	2.5400 % CGB 2.54 12/25/30 INBK	0	30'000	0	30'000 CNY	101.45%	3'848'642.49	0.63	a)
<b>CN</b>							<b>44'274'619.80</b>	<b>7.30</b>	
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	5'000	0	0	5'000 CZK	105.28%	205'056.33	0.03	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	27'500	0	0	27'500 CZK	82.31%	881'742.80	0.15	a)
CZ0001005870	1.2500 % CZGB 1 1/4 02/14/25 120	13'000	0	0	13'000 CZK	97.48%	493'643.06	0.08	a)
CZ0001006167	0.0000 % CZGB 0 12/12/24 135	10'000	0	0	10'000 CZK	97.00%	377'859.58	0.06	a)
<b>CZ</b>							<b>1'958'301.77</b>	<b>0.32</b>	
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	0	16'500	8'000	8'500 EUR	95.69%	7'976'242.43	1.31	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	0	5'500	2'500	3'000 EUR	83.48%	2'455'984.59	0.40	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	0	3'500	1'500	2'000 EUR	50.05%	981'726.98	0.16	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	0	3'250	3'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQC36	0.1250 % HESSEN 0 1/8 01/25/24 1701	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A254RB5	0.0000 % NIESA 0 02/11/27 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MQYR7	3.0000 % BERGER 3 05/04/28 548	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2331327564	0.0000 % KFW 0 06/15/29 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	8'500	0	8'500	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
XS2808428853	2.7500 % KFW 2 3/4 04/26/27 EMTN	0	35'000	0	35'000 CNY	100.01%	4'426'395.36	0.73	a)
<b>DE</b>							<b>15'840'349.36</b>	<b>2.61</b>	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	2'000	0	0	2'000 DKK	121.82%	320'353.95	0.05	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	6'500	0	0	6'500 DKK	89.59%	765'705.55	0.13	a)
<b>DK</b>							<b>1'086'059.50</b>	<b>0.18</b>	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	5'000	2'250	7'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	700	0	0	700 EUR	48.21%	330'966.58	0.05	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	7'000	0	0	7'000 EUR	71.64%	4'917'647.24	0.81	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	3'250	0	0	3'250 EUR	64.44%	2'053'717.08	0.34	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	10'000	0	0	10'000 EUR	82.71%	8'111'201.94	1.34	a)
ES0000090888	0.7000 % ANDAL 0.7 07/30/33	2'400	0	0	2'400 EUR	77.61%	1'826'701.79	0.30	a)
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>ES</b>							<b>17'240'234.63</b>	<b>2.84</b>	
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34 16Y	2'000	5'000	2'000	5'000 EUR	84.36%	4'136'457.03	0.68	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29 10Y	0	3'750	3'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 19Y	6'000	0	4'000	2'000 EUR	65.30%	1'280'791.45	0.21	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53 31Y	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	94.33%	2'312'610.95	0.38	a)
FR001400F7C9	2.8750 % AGFRNC 2 7/8 01/21/30	0	3'000	0	3'000 EUR	98.09%	2'885'664.21	0.48	a)
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	4'500	0	2'500	2'000 EUR	100.94%	1'979'674.21	0.33	a)
<b>FR</b>							<b>12'595'197.85</b>	<b>2.08</b>	
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	2'000	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	1'200	3'000	1'200	3'000 GBP	59.33%	2'044'122.74	0.34	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	4'000	0	1'800	2'200 GBP	78.54%	1'984'338.85	0.33	a)
GB00BLDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	2'000	0	0	2'000 GBP	34.75%	798'052.64	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	0	4'150	2'100	2'050 GBP	96.72%	2'276'949.54	0.38	a)
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	6'000	2'600	3'600	5'000 GBP	73.97%	4'247'162.37	0.70	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	4'000	0	700	3'300 GBP	48.90%	1'853'188.20	0.31	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	5'500	0	0	5'500 GBP	38.48%	2'430'683.08	0.40	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	3'750	750	0	4'500 GBP	85.66%	4'426'825.28	0.73	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	1'600	600	2'200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	1'000	0	0	1'000 GBP	91.65%	1'052'563.12	0.17	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	4'750	150	0	4'900 GBP	72.36%	4'071'789.93	0.67	a)
USG6398ADD66	5.2640 % NWIDE 5.264 11/10/26 REGS	0	4'500	0	4'500 USD	99.81%	4'119'127.01	0.68	a)
XS2507889835	2.7500 % IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	1'600	0	0	1'600 GBP	97.13%	1'784'701.66	0.29	a)
<b>GB</b>							<b>31'089'504.42</b>	<b>5.12</b>	
GR0138018842	4.1250 % GGB 4 1/8 06/15/54	0	3'400	0	3'400 EUR	99.76%	3'326'201.79	0.55	a)
<b>GR</b>							<b>3'326'201.79</b>	<b>0.55</b>	
HU0000403118	3.0000 % HGB 3 10/27/27 27/A	0	80'000	0	80'000 HUF	87.32%	175'252.99	0.03	a)
HU0000404934	1.5000 % HGB 1 1/2 08/26/26 26/F	0	140'000	0	140'000 HUF	88.14%	309'594.02	0.05	a)
<b>HU</b>							<b>484'847.01</b>	<b>0.08</b>	
IDG000009507	8.3750 % INDOGB 8 3/8 09/15/26 FR56	20'000'000	0	0	20'000'000 IDR	102.86%	1'160'511.65	0.19	a)
IDG000010307	6.1250 % INDOGB 6 1/8 05/15/28 FR64	16'800'000	0	0	16'800'000 IDR	96.50%	914'518.92	0.15	a)
<b>ID</b>							<b>2'075'030.57</b>	<b>0.34</b>	
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	4'000	0	0	4'000 ILS	96.73%	950'781.48	0.16	a)
<b>IL</b>							<b>950'781.48</b>	<b>0.16</b>	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	0	7'000	0	7'000 EUR	76.41%	5'245'298.18	0.86	a)
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24 4Y	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	4'000	0	0	4'000 EUR	69.61%	2'730'610.82	0.45	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	5'500	2'000	4'500	3'000 EUR	81.06%	2'384'905.78	0.39	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	4'500	0	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>IT</b>							<b>10'360'814.78</b>	<b>1.71</b>	
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	1'000'000	0	1'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024351N46	0.0050 % JGB 0.005 04/01/24 435	0	625'000	625'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	0	1'100'000	0	1'100'000 JPY	99.97%	6'408'999.59	1.06	a)
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	0	1'800'000	0	1'800'000 JPY	99.94%	10'483'887.04	1.73	a)
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	2'200'000	0	0	2'200'000 JPY	100.01%	12'823'384.42	2.11	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	1'500'000	0	1'500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	1'600'000	1'150'000	450'000	2'300'000 JPY	99.34%	13'316'453.43	2.19	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	1'500'000	300'000	1'800'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	1'575'000	0	1'575'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	1'200'000	0	1'200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	1'000'000	0	1'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1120281P52	0.0050 % JGBI 0.005 03/10/33 28	0	3'500'000	0	3'500'000 JPY	108.22%	22'075'588.79	3.64	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	500'000	0	325'000	175'000 JPY	99.70%	1'016'839.36	0.17	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	90.09%	5'250'831.48	0.87	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	600'000	100'000	0	700'000 JPY	92.38%	3'768'762.82	0.62	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	0	400'000	0	400'000 JPY	89.41%	2'084'363.41	0.34	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	1'000'000	250'000	0	1'250'000 JPY	85.80%	6'250'712.33	1.03	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	1'100'000	550'000	0	1'650'000 JPY	84.74%	8'148'620.92	1.34	a)
JP1201871Q14	1.3000 % JGB 1.3 12/20/43 187	0	600'000	0	600'000 JPY	94.47%	3'303'453.38	0.54	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	700'000	0	0	700'000 JPY	78.76%	3'213'227.48	0.53	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	1'000'000	650'000	100'000	1'550'000 JPY	74.81%	6'758'354.67	1.11	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	0	450'000	0	450'000 JPY	87.93%	2'306'066.99	0.38	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	350'000	0	0	350'000 JPY	66.23%	1'350'998.95	0.22	a)
XS0241265445	4.5000 % EJRAIL 4 1/2 01/25/36	1'300	0	0	1'300 GBP	91.96%	1'372'960.15	0.23	a)
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REGS	0	4'500	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2296155562	1.3750 % JFM 1 3/8 02/10/31 REGS	6'000	0	2'000	4'000 USD	78.01%	2'861'838.17	0.47	a)
XS2377379461	0.1000 % JFM 0.1 09/03/31 GMTN	0	8'000	0	8'000 EUR	78.36%	6'147'296.87	1.01	a)
<b>JP</b>							<b>118'942'640.25</b>	<b>19.60</b>	
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	4'500'000	0	0	4'500'000 KRW	96.91%	2'893'855.63	0.48	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	2'000'000	0	0	2'000'000 KRW	78.86%	1'046'562.65	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	3'500'000	0	0	3'500'000 KRW	75.08%	1'743'754.54	0.29	a)
KR103502GA67	1.3750 % KTB 1 3/8 06/10/30 3006	5'000'000	0	0	5'000'000 KRW	87.69%	2'909'627.48	0.48	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	2'000'000	1'000'000	0	3'000'000 KRW	96.77%	1'926'469.54	0.32	a)
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	2'600	0	0	2'600 USD	100.13%	2'387'570.74	0.39	a)
<b>KR</b>							<b>12'907'840.58</b>	<b>2.13</b>	
XS2765498717	3.5000 % LITHUN 3 1/2 02/13/34 EMTN	0	4'100	2'100	2'000 EUR	98.04%	1'922'893.54	0.32	a)
<b>LT</b>							<b>1'922'893.54</b>	<b>0.32</b>	
EU000A1G0EC4	0.0000 % EFSF 0 04/19/24	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	480'000	0	480'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	400'000	290'000	0	690'000 MXN	88.58%	3'290'058.52	0.54	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	100'000	0	0	100'000 MXN	80.80%	434'931.05	0.07	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	300'000	0	300'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MXMSG0000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	0	500'000	0	500'000 MXN	86.78%	2'335'520.52	0.38	a)
<b>MX</b>							<b>6'060'510.09</b>	<b>1.00</b>	
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	1'500	0	0	1'500 MYR	100.67%	290'186.45	0.05	a)
MYBMS1100036	4.3920 % MGS 4.392 04/15/26 0311	2'000	0	0	2'000 MYR	101.65%	390'697.25	0.06	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	3'000	0	0	3'000 MYR	99.80%	575'345.63	0.09	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	4'000	0	0	4'000 MYR	106.59%	819'360.37	0.14	a)
<b>MY</b>							<b>2'075'589.70</b>	<b>0.34</b>	
AU3CB0241974	3.5000 % NEDWBK 3 1/2 07/20/27 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	96.44%	574'355.68	0.09	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	3'000	3'000	0	6'000 AUD	93.18%	3'329'572.75	0.55	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	79.63%	1'952'362.61	0.32	a)
XS1632891138	0.6250 % BNG 0 5/8 06/19/27 EMTN	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1956184532	2.6250 % BNG 2 5/8 02/27/24 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2101563646	1.7500 % NEDWBK 1 3/4 01/15/25 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	97.42%	3'573'766.69	0.59	a)
XS2180643889	1.0000 % NEDWBK 1 05/28/30 REGS	0	8'000	0	8'000 USD	79.56%	5'837'769.81	0.96	a)
XS2226241854	0.1250 % NEDWBK 0 1/8 09/03/35	4'000	0	0	4'000 EUR	70.79%	2'776'662.98	0.46	a)
XS232592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	76.81%	4'519'741.26	0.74	a)
XS2381566616	0.0000 % BNG 0 08/31/28 EMTN	6'500	3'500	5'000	5'000 EUR	87.64%	4'297'041.40	0.71	a)
XS2436690734	1.1250 % NEDWBK 1 1/8 03/15/24 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2485170695	2.8750 % NEDWBK 2 7/8 05/24/24 EMTN	4'000	0	0	4'000 USD	99.83%	3'662'510.12	0.60	a)
<b>NL</b>							<b>30'523'783.30</b>	<b>5.03</b>	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	3'000	0	3'000	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	10'000	3'500	0	13'500 NOK	88.25%	986'628.96	0.16	a)
XS2014307800	2.0000 % KBN 2 06/19/24 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.54%	912'931.11	0.15	a)
<b>NO</b>							<b>1'899'560.07</b>	<b>0.31</b>	
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	2'750	0	2'750	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	0	3'250	3'250	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	2'500	500	0	3'000 NZD	61.55%	1'002'090.12	0.17	a)
NZLGFDT019C9	3.0000 % NZLGFA 3 05/15/35	0	1'500	0	1'500 NZD	78.45%	638'649.89	0.11	a)
XS2353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	2'350	2'400	0	4'750 EUR	86.65%	4'036'492.66	0.67	a)
XS2500847657	1.7770 % WSTPNZ 1.777 01/14/26 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	96.99%	1'902'240.67	0.31	a)
<b>NZ</b>							<b>7'579'473.34</b>	<b>1.25</b>	
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	0	1'500	0	1'500 PLN	76.88%	261'371.78	0.04	a)
<b>PL</b>							<b>261'371.78</b>	<b>0.04</b>	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	2'000	0	0	2'000 SEK	110.82%	185'198.15	0.03	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	8'500	0	0	8'500 SEK	84.97%	603'482.04	0.10	a)
US50046PBN42	0.3750 % KOMINS 0 3/8 02/16/24 144A	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87031CAH60	4.6250 % SEK 4 5/8 11/28/25 GMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	3'000	0	0	3'000 SEK	86.31%	216'372.84	0.04	a)
XS2311395169	0.3750 % KOMINS 0 3/8 06/19/24 REGS	7'000	0	0	7'000 USD	99.31%	6'376'008.46	1.05	a)
XS2462606489	0.8750 % KOMINS 0 7/8 09/01/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	89.74%	3'520'283.80	0.58	a)
XS2490493959	2.8750 % KOMINS 2 7/8 07/03/24 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	99.54%	4'564'563.84	0.75	a)
XS2717359447	5.2500 % KOMINS 5 1/4 04/16/25 REGS	0	5'000	3'000	2'000 USD	99.73%	1'829'420.76	0.30	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>SE</b>							<b>17'295'329.89</b>	<b>2.85</b>	
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	600	0	0	600 SGD	97.25%	392'411.75	0.06	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	750	400	0	1'150 SGD	97.13%	751'171.23	0.12	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	1'200	0	0	1'200 SGD	88.52%	714'394.44	0.12	a)
<b>SG</b>							<b>1'857'977.42</b>	<b>0.31</b>	
XS2635185437	5.0000 % SLOVEN 5 09/19/33 REGS	3'400	0	0	3'400 USD	97.27%	3'033'242.50	0.50	a)
<b>SI</b>							<b>3'033'242.50</b>	<b>0.50</b>	
TH0623035C07	3.8500 % THAIGB 3.85 12/12/25	40'000	15'000	0	55'000 THB	102.30%	1'392'416.29	0.23	a)
TH0623037C05	3.5800 % THAIGB 3.58 12/17/27	44'000	0	0	44'000 THB	103.53%	1'127'282.94	0.19	a)
TH062303FC01	1.5850 % THAIGB 1.585 12/17/35	0	1'000	0	1'000 THB	87.44%	21'639.89	0.00	a)
TH0623A3B608	3.6500 % THAIGB 3.65 06/20/31	22'000	3'000	0	25'000 THB	106.21%	657'125.94	0.11	a)
<b>TH</b>							<b>3'198'465.06</b>	<b>0.53</b>	
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	3'000	0	0	3'000 USD	74.61%	2'052'839.65	0.34	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	3'250	0	2'250	1'000 USD	70.06%	642'578.22	0.11	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	10'000	4'000	2'000	12'000 USD	47.23%	5'198'520.84	0.86	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	12'000	0	9'000	3'000 USD	48.80%	1'342'621.62	0.22	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	14'000	6'000	2'000	18'000 USD	58.27%	9'618'897.23	1.59	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	14'000	4'000	0	18'000 USD	58.84%	9'714'338.16	1.60	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	0	5'500	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	9'000	2'000	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	25'000	19'500	0	44'500 USD	78.72%	32'127'621.20	5.29	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	10'000	1'000	5'500	5'500 USD	86.66%	4'371'617.00	0.72	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	9'500	0	9'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	3'500	4'250	7'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	10'000	5'000	3'500	11'500 USD	85.63%	9'031'885.47	1.49	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	0	14'500	3'900	10'600 USD	98.57%	9'582'419.01	1.58	a)
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	18'500	1'500	2'750	17'250 USD	85.89%	13'588'616.21	2.24	a)
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	0	13'500	0	13'500 USD	97.88%	12'118'901.22	2.00	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	30'000	0	0	30'000 USD	79.09%	21'762'249.84	3.59	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	7'750	0	7'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	6'000	0	6'000 USD	94.70%	5'211'418.27	0.86	a)
<b>US</b>							<b>136'364'523.94</b>	<b>22.47</b>	
EU000A3K4D66	0.0000 % EUB 0 11/10/23 6M	5'650	0	5'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	0	5'000	0	5'000 EUR	85.72%	4'202'897.28	0.69	a)
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	0	3'500	1'500	2'000 EUR	83.71%	1'641'814.52	0.27	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	4'750	7'000	11'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EM7	0.0000 % EUB 0 05/10/24 6M	0	8'750	1'250	7'500 EUR	99.93%	7'349'492.69	1.21	a)
EU000A3K4EV8	0.0000 % EUB 0 10/04/24 6M	0	500	0	500 EUR	98.43%	482'650.40	0.08	a)
EU000A3KRJQ6	0.0000 % EU 0 07/04/29 SURE	6'000	2'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	4'500	0	0	4'500 EUR	62.98%	2'779'222.52	0.46	a)
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1422953932	1.0000 % EIB 1 04/14/32 EARN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1821973606	6.7700 % CAF 6.77 05/24/28 EMTN	0	7'000'000	0	7'000'000 COP	84.44%	1'392'847.03	0.23	a)
XS2332976237	1.0000 % EIB 1 02/15/27 EMTN	0	10'000	0	10'000 PLN	88.48%	2'005'567.25	0.33	a)
XS2577528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	30'000	0	30'000 CNY	99.62%	3'779'258.28	0.62	a)
<b>XS</b>							<b>23'633'749.97</b>	<b>3.89</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-970'605.84</b>	<b>-0.16</b>	
<b>Futures</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	-100	100	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	30	0	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US ULTRA BOND CBT DEC23	-30	30	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	LONG GILT FUTURE DEC23	0	50	50	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	100	0	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	130	130	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR NOTE (CBT)MAR24	0	85	85	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US ULTRA BOND CBT MAR24	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 5YR NOTE (CBT) MAR24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	25	0	25 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US 10YR NOTE (CBT)JUN24	0	85	25	60 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US ULTRA BOND CBT JUN24	0	20	30	-10 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	100	0	100 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US 5YR NOTE (CBT) JUN24	0	100	50	50 USD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

CHF/USD	Verfall 21.02.2024	3'397'859	3'000'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 06.05.2024	1'600'000	1'836'755	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/MXN	Verfall 07.05.2024	14'876'027	800'000	MXN/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.05.2024	16'000'000	14'668'640	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 07.05.2024	9'000'000	8'824'194	EUR/CHF	0.00	0.00

#### Devisentermingeschäfte

**0.00 0.00**

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

MXN/CHF	Verfall 16.11.2023	3'195'165	61'800'000	CHF/MXN	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 16.11.2023	220'560	2'650'000	CHF/NOK	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023	12'960'133	11'750'000	CHF/GBP	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall 16.11.2023	359'204	2'800'000	CHF/DKK	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 16.11.2023	1'142'340	2'150'000	CHF/NZD	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall 16.11.2023	689'330	3'350'000	CHF/PLN	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023	58'013'843	60'700'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023	4'945'317	7'450'000	CHF/CAD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 16.11.2023	82'771'697	93'050'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023	52'861'548	8'700'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023	21'331'406	174'550'000	CHF/CNY	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 16.11.2023	298'438	3'700'000	CHF/SEK	0.00	0.00
CZK/CHF	Verfall 16.11.2023	532'343	13'650'000	CHF/CZK	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 16.11.2023	4'342'785	7'500'000	CHF/AUD	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall 16.11.2023	491'667	2'100'000	CHF/ILS	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 16.11.2023	655'103	1'000'000	CHF/SGD	0.00	0.00
HUF/CHF	Verfall 16.11.2023	53'257	21'650'000	CHF/HUF	0.00	0.00
THB/CHF	Verfall 16.11.2023	1'391'220	56'250'000	CHF/THB	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.11.2023	350'000	311'491	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023	90'000'000	547'168	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.11.2023	650'000	590'455	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 16.11.2023	273'541	300'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023	1'106'887	180'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall 16.11.2023	12'837	250'000	CHF/MXN	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023	241'340	250'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CZK/CHF	Verfall 16.11.2023	5'927	150'000	CHF/CZK	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023	293'778	2'350'000	CHF/CNY	0.00	0.00
THB/CHF	Verfall 16.11.2023	16'203	650'000	CHF/THB	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall 16.11.2023	11'886	50'000	CHF/ILS	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023	111'277	100'000	CHF/GBP	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 16.11.2023	33'420	50'000	CHF/SGD	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall 16.11.2023	10'378	50'000	CHF/PLN	0.00	0.00
HUF/CHF	Verfall 16.11.2023	850	350'000	CHF/HUF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 16.11.2023	100'000	57'887	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023	500'000	480'151	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 16.11.2023	100'000	110'716	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023	60'000'000	369'942	JPY/CHF	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023	121'222	20'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023	859'357	900'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 16.11.2023	858'172	950'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023	220'755	200'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023	650'000	614'373	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 16.11.2023	150'000	163'342	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.11.2023	1'300'000	1'164'810	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023	100'000'000	598'637	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 16.11.2023	100'000	108'609	GBP/CHF	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall 16.11.2023	234'911	1'100'000	CHF/PLN	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023	166'230	1'350'000	CHF/CNY	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 16.11.2023	131'796	200'000	CHF/SGD	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 16.11.2023	4'042	50'000	CHF/NOK	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023	109'456	100'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023	65'058	100'000	CHF/CAD	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 16.11.2023	4'053	50'000	CHF/SEK	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		138'899	23'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		100'000	57'269		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		1'532'006	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		47'233	950'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		185'372	1'450'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		8'715	350'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		1'001'708	1'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		2'087'799	16'850'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		449'104	11'500'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		7'723'619	8'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		183'094	2'250'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		15'067	300'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		6'390'750	6'650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		26'427	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		518'033	900'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		10'125	400'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		288'878	3'550'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		4'419'555	735'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		1'819'452	1'650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		864'553	15'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		4'002'668	6'000'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		900'000	1'350'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		263'312	4'500'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		150'000'000	101'554		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		75'000'000	4'379		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		80'000'000	4'532		IDR/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		26'570	40'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		8'484	150'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		67'162	100'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		7'340'000'000	4'981'242		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		19'495'000'000	1'120'003		IDR/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		505'151	6'050'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		821'306	1'250'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		5'002'274	8'700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		24'364'963	199'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		3'290'160	65'300'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		92'609'554	104'550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		996'650	25'450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		555'336	4'300'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		4'974'138	7'700'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		66'723'357	69'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		514'943	2'200'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		1'164'381	2'200'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		56'373'190	9'500'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		15'234'317	13'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		1'433'931	58'100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		989'921	4'550'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 18.01.2024		56'476	22'300'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		511'403	6'300'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 18.01.2024		6'000'000	302'008		MXN/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		912'630	950'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		964'009	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'569'954	2'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		2'679'886	2'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 18.01.2024		741	300'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		10'861	50'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		200'137	350'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		224'697	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		1'935'434	325'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		32'524	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		828'532	6'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		548'903	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		17'474	700'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		106'280	2'150'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		25'277	200'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		783'067	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		53'458	100'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		24'967	300'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		1'177'455	1'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		19'956	250'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		32'789	850'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		11'705	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		600'000	564'743		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		1'189'376	200'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 18.01.2024		950'000	544'263	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		767'264	6'300'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		3'000'000	18'380	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		713'352	650'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'246'332	2'600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		17'302	450'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		8'256	100'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		2'484	100'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		12'647	150'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		12'674	100'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		87'195	150'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		403'095	750'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		129'288	200'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		92'513	1'850'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		12'146	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		708'256	750'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 18.01.2024		50'000	6'345	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		650'000'000	3'949'062	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		650'000	25'017	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		7'550'000	6'531'973	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 18.01.2024		11'150'000	1'352'885	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 18.01.2024		100'000	8'488	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 18.01.2024		50'000	11'814	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		4'200'000	3'971'218	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 18.01.2024		150'000	12'481	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		1'750'000	43'356	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 18.01.2024		50'000	10'887	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 18.01.2024		550'000	318'826	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 18.01.2024		550'000	295'288	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 18.01.2024		650'000	1'593	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 18.01.2024		1'800'000	89'881	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		550'000	601'747	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 18.01.2024		200'000	129'230	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		8'737'024	10'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		61'598	2'500'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		1'464'024	1'350'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		5'932'697	6'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		5'312'754	880'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		1'314'339	10'950'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		269'017	500'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		387'567	7'750'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		464'648	800'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		128'702	200'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		38'236	1'000'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		12'630	100'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 18.01.2024		1'592	650'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		11'813	50'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		8'317	100'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		21'659	100'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		16'936	200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		200'000	214'317	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		1'000'000	841'382	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		250'000'000	1'495'513	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		450'000	418'729	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 18.01.2024		1'000'000	118'289	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		600'000	647'785	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		1'150'000	1'068'835	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 18.01.2024		1'850'000	153'957	SEK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		761'658	130'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		5'205'432	7'700'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		1'080'128	19'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		50'562	900'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		430'749	650'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		3'059	55'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		113'084	170'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		270'000'000	180'602	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 19.01.2024		580'000'000	32'493	IDR/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		193'548	300'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		35'714	650'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 19.01.2024		20'025'000'000	1'104'200	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		8'550'000'000	5'514'208	KRW/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.02.2024		701'797	750'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.02.2024		2'941'183	3'150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 08.03.2024		1'093'565	20'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	IDR/CHF Verfall 08.03.2024		98'453	1'750'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 08.03.2024		44'457	800'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 08.03.2024	22'550'000'000		1'267'666	IDR/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		1'005'741	4'750'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		65'700'219	70'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		15'476'604	14'300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		510'941	2'250'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		1'416'374	60'450'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		995'009	26'500'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		829'811	1'300'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		5'109'182	8'050'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		24'847'174	209'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 14.03.2024		56'199	22'800'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		538'502	6'550'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		55'465'169	9'450'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		91'952'239	107'550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		2'845'522	57'700'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		4'154'095	7'350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		1'576'620	3'000'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		540'038	6'600'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		575'230	4'600'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 14.03.2024		675'000	1'648	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 14.03.2024		25'000	5'686	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024	1'825'000		44'362	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 14.03.2024	100'000		12'520	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024	325'000		171'031	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024	200'000		16'395	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024	125'000		26'518	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024	150'000		12'347	SEK/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024	246'664		5'000'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024	4'097		50'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024	586'400		100'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024	451'836		800'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024	243'550		10'000'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024	6'295		50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024	273'266		250'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024	4'119		50'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024	11'342		300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024	938'515		1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024	1'899'036		2'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024	838'901		7'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024	100'000		52'879	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024	500'000		471'582	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024	750'000		648'322	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024	1'544'017		1'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024	2'914'432		3'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024	2'045'895		17'100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024	383'700		600'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024	2'758'490		470'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024	1'074'906		1'250'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024	2'500'000		2'207'243	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024	2'225'450		2'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024	100'000		65'166	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024	1'892'944		2'150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024	2'416'181		2'550'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024	527'811		90'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024	159'768		6'500'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024	88'031		400'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024	444'545		400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024	374'726		650'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024	8'000'000		979'352	CNY/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024	65'571		100'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024	34'094		400'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024	264'013		5'150'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024	38'336		300'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024	50'000		44'024	USD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024	81'691		150'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024	48'448		200'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024	101'371		2'700'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024	285'703		300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024	37'697		450'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 14.03.2024	5'160		2'100'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024	20'768		250'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024	16'990		200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		3'094'511	530'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		199'820	350'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		68'243	2'800'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		161'971	250'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		12'235	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 14.03.2024		2'056	850'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		8'216'827	9'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		25'565	200'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		44'074	200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		1'946'369	1'750'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		1'742'498	14'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		6'764'383	7'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		125'716	2'450'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		53'505	100'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		32'648	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		33'790	900'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		5'495'855	8'550'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		200'000'000	128'783		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		73'776	115'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		394'737	600'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		242'718	375'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		9'440'000'000	6'321'502		KRW/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		108'154'126	123'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		79'088'326	82'700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		62'520'079	10'495'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		18'054'570	16'150'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		5'798'795	8'950'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		28'880'714	236'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		602'272	7'250'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		611'125	7'150'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.04.2024		647'885	5'050'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		1'146'910	30'400'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		1'157'380	5'200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 25.04.2024		59'364	24'900'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.04.2024		953'223	1'450'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 25.04.2024		597'230	2'500'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		3'633'752	70'400'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		1'900'238	77'500'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		2'438'008	410'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		2'400'000	2'297'770		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		1'250'000	1'202'763		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		110'000'000	652'641		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		100'000	89'989		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		1'122'307	1'150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		2'250'000	13'421		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		50'000	4'258		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		200'000	7'703		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		50'000	2'688		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		200'000	24'870		CNY/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		2'482	100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 25.04.2024		994	400'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		806'173	135'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		4'246	50'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		33'438	50'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		473'871	3'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		11'576	300'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		4'209	50'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.04.2024		13'126	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		1'355'696	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		57'032	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		28'341	1'150'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		35'316	650'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		2'055'782	2'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		22'770	100'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		300'000	340'741		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		1'750'000	93'638		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		450'000	17'277		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		1'650'000	1'505'516		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		250'000'000	1'470'675		JPY/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		5'283'658	9'150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		1'557'961	2'900'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		882'722	1'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		27'059	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		88'787	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/NZD Verfall 26.04.2024		50'000	26'807		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		150'000	87'581		AUD/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.04.2024		1'260'837	22'600'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		6'276'521	9'400'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.04.2024		600'000'000	33'994		IDR/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.04.2024		1'977	35'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.04.2024		16'949	300'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		80'214	120'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		9'520'000'000	6'303'592		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.04.2024		22'335'000'000	1'256'540		IDR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		110'374'233	121'700'000		CHF/USD	-879'530.10	-0.14	b)
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		17'704'749	15'700'000		CHF/GBP	-268'657.61	-0.04	b)
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		5'875'152	8'850'000		CHF/CAD	-16'276.63	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		78'455'973	80'750'000		CHF/EUR	-566'598.74	-0.09	b)
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		60'840'291	10'330'000'000		CHF/JPY	562'059.80	0.09	b)
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		6'174'210	10'500'000		CHF/AUD	-64'048.08	-0.01	b)
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		30'786'668	246'250'000		CHF/CNY	-296'263.32	-0.05	b)
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		657'970	5'050'000		CHF/DKK	-4'823.78	0.00	b)
	HUF/CHF Verfall 30.05.2024		61'881	25'150'000		CHF/HUF	-900.90	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		602'588	2'500'000		CHF/ILS	-10'170.35	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		3'668'490	69'150'000		CHF/MXN	-25'141.31	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		1'903'868	77'700'000		CHF/THB	-14'339.29	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		967'385	1'450'000		CHF/SGD	-5'828.35	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		595'236	7'100'000		CHF/SEK	3'126.03	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		1'533'554	2'850'000		CHF/NZD	-8'207.49	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 30.05.2024		593'050	7'150'000		CHF/NOK	2'376.77	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		1'152'147	30'000'000		CHF/CZK	-12'569.23	0.00	b)
	CHF/NZD Verfall 30.05.2024		1'000'000	541'915		NZD/CHF	-941.82	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 30.05.2024		750'000	499'910		CAD/CHF	-634.33	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 30.05.2024		1'000'000	974'519		EUR/CHF	4'092.04	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 30.05.2024		300'000	341'069		GBP/CHF	2'375.23	0.00	b)
	CHF/CZK Verfall 30.05.2024		50'000	1'935		CZK/CHF	6.47	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		100'244	150'000		CHF/SGD	-433.18	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 30.05.2024		450'000	56'487		CNY/CHF	314.85	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 30.05.2024		4'130	50'000		CHF/NOK	-0.11	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		876'218	900'000		CHF/EUR	-4'531.47	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		1'815'820	2'000'000		CHF/USD	-12'510.28	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		284'862	250'000		CHF/GBP	-1'342.34	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		581'881	100'000'000		CHF/JPY	-1'636.89	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		2'454	100'000		CHF/THB	-14.53	0.00	b)
	HUF/CHF Verfall 30.05.2024		223'437	90'000'000		CHF/HUF	-1'231.77	0.00	b)
	CHF/MXN Verfall 30.05.2024		300'000	15'913		MXN/CHF	111.11	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		12'511	150'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		59'421	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		534'318	10'000'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		4'783'593	820'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		6'900'681	7'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		29'623	1'200'000		CHF/THB	0.00	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		19'417	500'000		CHF/CZK	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		8'321'277	9'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		12'260	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		13'126	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 30.05.2024		12'392	150'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		99'869	150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	HUF/CHF Verfall 30.05.2024		15'109	6'050'000		CHF/HUF	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		1'431'438	1'250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		33'564	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		1'950'702	15'450'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		1'191'906	5'300'000		CHF/PLN	-4'842.44	0.00	b)
	CHF/PLN Verfall 31.05.2024		50'000	11'252		PLN/CHF	38.14	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		146'416	650'000		CHF/PLN	-355.62	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		22'595	100'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		6'269'592	9'500'000'000		CHF/KRW	-23'288.18	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 31.05.2024		1'240'223	22'200'000'000		CHF/IDR	-6'426.43	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 31.05.2024		200'000'000	133'333		KRW/CHF	-850.06	0.00	b)
	CHF/IDR Verfall 31.05.2024		200'000'000	11'206		IDR/CHF	25.51	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		33'048	50'000'000		CHF/KRW	-72.38	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>-1'657'941.06</b>	<b>-0.27</b>	

## Swaps

09/28	IRS FIX LEG 3.37% P.A. EUR	23'000	0	0	23'000 EUR	103.05%	23'242'696.00	3.83	b)
							<b>687'335.22</b>	<b>0.11</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
09/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EURIBOR 6M EUR	-23'000	0	0	-23'000 EUR	100.00	-22'555'360.78	-3.72	b)
06/33	IRS FIX LEG 0.56925% P.A. JPY	1'200'000	0	1'200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
06/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-1'200'000	1'200'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	6'297'325.49	1.04
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	597'636'883.22	98.49
Derivative Finanzinstrumente	-970'605.84	-0.16
Sonstige Vermögenswerte	3'847'068.11	0.63
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>606'810'670.98</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-34'922'684.31	
Andere Verbindlichkeiten	-33'883.83	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>571'854'102.84</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);	597'636'883.22	98.49
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'348'189.50	-0.22
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## Ausgeliehene Effekten

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>154'312'184.26</b>	<b>25.43</b>
BE0000360694 2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	9'000 EUR 97.70%	8'622'924.23 1.42
DE0001030716 0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	2'982 EUR 95.69%	2'798'253.52 0.46
DE0001030732 0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	2'911 EUR 83.48%	2'383'123.71 0.39
DE0001102481 0.0000 % DBR 0 08/15/50	1'200 EUR 50.05%	589'036.19 0.10
EU000A3KT6B1 0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	1'500 EUR 62.98%	926'407.51 0.15
FR0013515806 0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 19Y	2'000 EUR 65.30%	1'280'791.45 0.21
FR001400ITG9 3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	2'000 EUR 100.94%	1'979'674.21 0.33
GB00BLPK7110 0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	150 GBP 96.72%	166'606.06 0.03
GB00BM8Z2S21 0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	5'000 GBP 73.97%	4'247'162.37 0.70
GB00BM8Z2V59 1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	3'300 GBP 48.90%	1'853'188.20 0.31
GB00MBL1G81 0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	4'500 GBP 85.66%	4'426'825.28 0.73
GB00BZB26Y51 1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	4'900 GBP 72.36%	4'071'789.93 0.67
US912810RP57 3.0000 % T 3 11/15/45	3'000 USD 74.61%	2'052'839.65 0.34
US912810RY64 2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'000 USD 70.06%	642'578.22 0.11
US912810SN90 1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	8'000 USD 47.23%	3'465'680.56 0.57
US912810SP49 1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	2'943 USD 48.80%	1'317'111.81 0.22
US912810SQ22 1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	18'000 USD 58.27%	9'618'897.23 1.59
US912810SR05 1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	13'970 USD 58.84%	7'539'405.78 1.24
US912828ZQ64 0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	42'070 USD 78.72%	30'373'236.49 5.01
US91282CAD39 0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	5'500 USD 86.66%	4'371'617.00 0.72
US91282CCR07 1.0000 % T 1 07/31/28	11'361 USD 85.63%	8'922'717.45 1.47
US91282CCT62 0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	9'500 USD 98.57%	8'588'017.03 1.42
US91282CCV19 1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	17'197 USD 85.89%	13'546'865.68 2.23
US91282CDJ71 1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	30'000 USD 79.09%	21'762'249.84 3.59
US91282CJZ59 4.0000 % T 4 02/15/34	6'000 USD 94.70%	5'211'418.27 0.86
USC23264AK75 0.8750 % CADEPO 0 7/8 06/10/25 REGS	1'000 USD 95.14%	872'530.65 0.14
XS2296155562 1.3750 % JFM 1 3/8 02/10/31 REGS	500 USD 78.01%	357'729.77 0.06
XS2676779304 3.6660 % TD 3.666 09/08/31	600 EUR 102.40%	602'516.45 0.10
XS2765498717 3.5000 % LITHUN 3 1/2 02/13/34 EMTN	1'790 EUR 98.04%	1'720'989.72 0.28

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59555135
CAD	1 = CHF	0.66757652
CNY	1 = CHF	0.12645200
COP	1'000 = CHF	0.23565000
CZK	100 = CHF	3.89529900
DKK	100 = CHF	13.14844400
EUR	1 = CHF	0.98066786
GBP	1 = CHF	1.14840937
HUF	100 = CHF	0.25088900
IDR	10'000 = CHF	0.56410000
ILS	1 = CHF	0.24572332
JPY	100 = CHF	0.58281700
KRW	1 = CHF	0.00066359
MXN	1 = CHF	0.05382810
MYR	1 = CHF	0.19217391
NOK	100 = CHF	8.28190000
NZD	1 = CHF	0.54272351
PLN	1 = CHF	0.22666387
SEK	100 = CHF	8.35603500
SGD	1 = CHF	0.67252062
THB	100 = CHF	2.47477100
USD	1 = CHF	0.91715000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	26'168'764.41	15.706
Bond	CHF	139'970'098.51	84.008
Equity	CHF	475'445.74	0.285
Total	CHF	166'614'308.66	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	49'541'917.28	8.663
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	362'291'616.23	63.354

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

Periode: 01.11.2023 - 30.04.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NT USD	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

## 7 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	154'312'184.26
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 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:** 01.11.2023 - 30.04.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	0.950	1.200	0.750	0.200	2.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NT USD	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000

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.

## 9 Benchmark

Bloomberg Global Treasury Total Return Index Unhedged CHF

## 10 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.

## 11 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.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.



## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert 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 in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- oder Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens 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, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens im Sinne von § 6 Ziff. 1 oben 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktconforme 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 Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken.

Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der modifizierte Nettoinventarwert wird jeweils auf 0.0001 der

Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit Rechnungseinheit JPY wird der modifizierte Nettoinventarwert jeweils auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

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 § 19 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 Prüfungsgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

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