

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND EMU GOVT.

## Halbjahresbericht per 31.08.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA EUR	31562120	EUR
FAH1 CHF	121592640	CHF
GT EUR	55960171	EUR
GTH1 CHF	121592641	CHF
NT EUR	11704515	EUR
NTH1 CHF	59570849	CHF

Rechnungswährung: EUR

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	17
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	18
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	18
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	18
8	Pauschale Verwaltungskommission	19
9	Benchmark	19
10	TER	19
11	Fussnoten	20
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	21

# 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	01.03.2024	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021
	bis	31.08.2024	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		979'451'320.89	725'605'004.51	119'453'366.14	418'783'066.93
<b>Klasse FA EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'146'528.49	10'440'871.87	8'495'874.88	14'263'535.05
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		127'957.594	132'323.434	111'261.796	154'231.124
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.2960	78.9042	76.3593	92.4816
Ausschüttung je Anteil		-	1.35	1.40	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse FAH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		62'885.22	62'492.70	9'783.09	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		600.000	600.000	100.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.4315	99.2471	97.2395	
Ausschüttung je Anteil		-	1.75	0.65	
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	
<b>Klasse GT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		41'617'259.76	36'711'878.41	29'270'642.95	289'997'544.23
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		492'337.340	441'436.345	368'188.946	3'046'843.296
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.5300	83.1646	79.4990	95.1797
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		79.3866	79.2462	79.0184	98.0811
Thesaurierung je Anteil		-	1.44	1.43	1.48
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse GTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)				9'784.96	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				100.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)				97.2581	
Thesaurierung je Anteil (in EUR)				0.70	
Total Expense Ratio (TER)				0.16 %	
<b>Klasse NT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		748'803'033.65	663'338'221.84	68'562'406.76	99'289'904.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'297'635.456	5'678'390.077	613'787.931	743'039.337
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		118.9023	116.8180	111.7037	133.6267
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		111.6675	111.3139	111.0285	137.7002
Thesaurierung je Anteil		-	1.80	2.17	2.27
Zwischenausschüttung je Anteil		-	0.39	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse NTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		178'821'613.77	15'051'539.69	13'104'873.50	15'232'083.25
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'097'388.004	179'691.664	166'865.802	166'865.802
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.0715	79.8165	78.0607	94.0661
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		-	1.57	1.53	1.48
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 FA EUR	2.24 %	7.05 %	-18.48 %	-3.63 %
Klasse FAH1 CHF (Lancierung 30.09.2022)	0.88 %	4.77 %	-2.66 %	-
Klasse GT EUR	2.26 %	7.09 %	-18.43 %	-3.59 %
Klasse GTH1 CHF (Lancierung 30.09.2022, Schliessung 28.02.2023)	-	-0.10 %	-2.64 %	-
Klasse NT EUR	2.33 %	7.24 %	-18.32 %	-3.46 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	0.98 %	4.98 %	-18.79 %	3.15 %
Benchmark Hedge	0.98 %	4.91 %	-	-
Benchmark	2.33 %	7.16 %	-18.52 %	-3.54 %
Tracking Error 33)	-	0.08 %	0.15 %	0.08 %

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 FA EUR	-0.09 %
Klasse FAH1 CHF (Lancierung 30.09.2022)	-0.10 %
Klasse GT EUR	-0.07 %
Klasse NT EUR	0.00 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	0.00 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	29.02.2024
Bankguthaben auf Sicht	532'730.15	1'424'621.57
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'025'548'453.51	716'966'166.01
Sonstige Vermögenswerte	9'031'361.89	7'219'814.19
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'035'112'545.55</b>	<b>725'610'601.77</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-55'654'985.60	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-6'239.06	-5'597.26
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>979'451'320.89</b>	<b>725'605'004.51</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse FA EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		132'323.434	111'261.796
Ausgegebene Anteile		5'006.340	68'634.562
Zurückgenommene Anteile		-9'372.180	-47'572.924
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>127'957.594</b>	<b>132'323.434</b>

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse FAH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		600.000	100.000
Ausgegebene Anteile		-	500.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>600.000</b>	<b>600.000</b>

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse GT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		441'436.345	368'188.946
Ausgegebene Anteile		106'417.970	3'681'054.741
Zurückgenommene Anteile		-55'516.975	-3'607'807.342
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>492'337.340</b>	<b>441'436.345</b>

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse GTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		-	100.000
Zurückgenommene Anteile		-	-100.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>-</b>	<b>-</b>

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse NT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'678'390.077	613'787.931
Ausgegebene Anteile		800'876.949	435'905.833
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		-	4'851'455.503
Zurückgenommene Anteile		-181'631.570	-222'759.190
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>6'297'635.456</b>	<b>5'678'390.077</b>

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse NTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		179'691.664	166'865.802
Ausgegebene Anteile		1'960'244.340	12'825.862
Zurückgenommene Anteile		-42'548.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'097'388.004</b>	<b>179'691.664</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		725'605'004.51	119'453'366.14
Ausbezahlte Ausschüttung		-172'858.67	-219'239.86
Zwischenausschüttung		0.00	-83'222.33
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'238'445.69	-2'420'656.46
Saldo aus dem Anteilverkehr		231'695'663.08	582'791'369.28
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		27'561'957.66	26'083'387.74
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>979'451'320.89</b>	<b>725'605'004.51</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.03.2024 31.08.2024</b>	<b>01.03.2023 29.02.2024</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		29'483.61	25'933.79
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		9'442'248.88	7'536'939.11
Erträge aus Wertpapierleihe		49'963.09	33'928.22
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		0.00	5'557'088.27
Sonstige Erträge		7'788.75	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'055'979.58	1'242'559.33
<b>Total Ertrag</b>		<b>10'585'463.91</b>	<b>14'396'448.72</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-36'941.32	-224'901.94
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-155'871.01	-2'600'147.69
<b>Total Aufwand</b>		<b>-192'812.33</b>	<b>-2'825'049.63</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			
		<b>10'392'651.58</b>	<b>11'571'399.09</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		4'643'711.18	-20'875'496.42
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		336'518.18	446'344.30
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>15'372'880.94</b>	<b>-8'857'753.03</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		12'189'076.72	34'941'140.77
<b>Gesamterfolg</b>		<b>27'561'957.66</b>	<b>26'083'387.74</b>



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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>1'025'548'453.51</b>	<b>99.08</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'025'548'453.51</b>	<b>99.08</b>	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	929	430	0	1'359 EUR	110.25%	1'498'283.91	0.14	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	1'569	645	0	2'214 EUR	112.35%	2'487'384.72	0.24	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	1'108	540	0	1'648 EUR	103.10%	1'699'088.00	0.16	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	470	160	0	630 EUR	114.50%	721'350.00	0.07	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	869	435	0	1'304 EUR	100.52%	1'310'780.80	0.13	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	994	410	0	1'404 EUR	96.78%	1'358'791.20	0.13	a)
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	1'254	100	0	1'354 EUR	98.24%	1'330'169.60	0.13	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	1'836	455	0	2'291 EUR	96.36%	2'207'515.96	0.21	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	1'104	365	0	1'469 EUR	74.17%	1'089'586.68	0.11	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	285	70	0	355 EUR	60.08%	213'284.00	0.02	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	1'580	595	0	2'175 EUR	95.02%	2'066'685.00	0.20	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	661	200	0	861 EUR	76.15%	655'651.50	0.06	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	1'254	700	0	1'954 EUR	94.31%	1'842'817.40	0.18	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	1'505	660	0	2'165 EUR	91.64%	1'984'006.00	0.19	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	1'473	515	0	1'988 EUR	87.08%	1'731'150.40	0.17	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	1'030	380	0	1'410 EUR	58.37%	823'017.00	0.08	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	517	250	0	767 EUR	46.09%	353'510.30	0.03	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	649	325	0	974 EUR	61.41%	598'133.40	0.06	a)
AT0000A2NWX83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	1'582	695	0	2'277 EUR	84.52%	1'924'520.40	0.19	a)
AT0000A2QXB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	359	425	0	784 EUR	45.30%	355'152.00	0.03	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	850	0	850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	884	290	0	1'174 EUR	72.78%	854'437.20	0.08	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	1'022	615	0	1'637 EUR	90.23%	1'477'048.73	0.14	a)
AT0000A2W5C8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	1'286	550	0	1'836 EUR	88.11%	1'617'699.60	0.16	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	654	300	0	954 EUR	78.48%	748'699.20	0.07	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	480	220	0	700 EUR	98.98%	692'860.00	0.07	a)
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	1'614	890	0	2'504 EUR	101.18%	2'533'547.20	0.24	a)
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	286	460	0	746 EUR	101.73%	758'905.80	0.07	a)
AT0000A335K7	3.1500 % RAGB 3.15 10/20/53	451	180	0	631 EUR	100.13%	631'820.30	0.06	a)
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	600	400	0	1'000 EUR	104.72%	1'047'240.00	0.10	a)
AT0000A39UW5	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/34	470	1'045	0	1'515 EUR	100.85%	1'527'938.10	0.15	a)
AT0000A3D3Q8	3.2000 % RAGB 3.2 07/15/39	0	570	0	570 EUR	101.90%	580'807.20	0.06	a)
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	2'155	815	0	2'970 EUR	110.27%	3'274'900.20	0.32	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	2'157	790	0	2'947 EUR	118.78%	3'500'535.01	0.34	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	1'834	680	0	2'514 EUR	113.39%	2'850'624.60	0.28	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	1'260	310	0	1'570 EUR	102.85%	1'614'745.00	0.16	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	947	400	0	1'347 EUR	108.89%	1'466'748.30	0.14	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	1'040	400	0	1'440 EUR	106.77%	1'537'488.00	0.15	a)
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	978	400	0	1'378 EUR	101.59%	1'399'910.20	0.14	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	2'330	0	2'330	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	1'829	745	0	2'574 EUR	90.07%	2'318'401.80	0.22	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	951	330	0	1'281 EUR	86.72%	1'110'883.20	0.11	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	1'752	955	302	2'405 EUR	97.31%	2'340'078.72	0.23	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	1'168	420	0	1'588 EUR	72.86%	1'157'016.80	0.11	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	949	310	0	1'259 EUR	74.49%	937'829.10	0.09	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	1'797	610	0	2'407 EUR	95.58%	2'300'610.60	0.22	a)
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	742	320	0	1'062 EUR	77.31%	821'032.20	0.08	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	721	320	0	1'041 EUR	83.36%	867'777.60	0.08	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	1'770	690	0	2'460 EUR	94.12%	2'315'327.40	0.22	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	1'230	470	0	1'700 EUR	88.96%	1'512'320.00	0.15	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	2'046	695	0	2'741 EUR	92.90%	2'546'389.00	0.25	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	1'167	460	0	1'627 EUR	71.71%	1'166'754.24	0.11	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	1'512	545	0	2'057 EUR	86.91%	1'787'738.70	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	913	370	0	1'283 EUR	65.77%	843'829.10	0.08	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	1'186	405	0	1'591 EUR	92.68%	1'474'538.80	0.14	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	1'471	550	0	2'021 EUR	83.04%	1'678'238.40	0.16	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	697	270	0	967 EUR	42.43%	410'298.10	0.04	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	1'789	575	0	2'364 EUR	83.59%	1'976'067.60	0.19	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	1'125	405	0	1'530 EUR	63.85%	976'905.00	0.09	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	574	435	0	1'009 EUR	95.82%	966'823.80	0.09	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	1'905	715	0	2'620 EUR	101.90%	2'669'780.00	0.26	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	1'165	405	0	1'570 EUR	97.50%	1'530'750.00	0.15	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	430	185	0	615 EUR	102.52%	630'498.00	0.06	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	650	1'365	0	2'015 EUR	99.88%	2'012'582.00	0.19	a)
BE0000361700	3.5000 % BGB 3 1/2 06/22/55 101	0	1'190	0	1'190 EUR	100.67%	1'197'973.00	0.12	a)
BE0000362716	2.7000 % BGB 2.7 10/22/29 102	0	1'170	0	1'170 EUR	100.77%	1'179'009.00	0.11	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	996	440	0	1'436 EUR	88.28%	1'267'629.00	0.12	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	768	600	0	1'368 EUR	97.19%	1'269'613.92	0.13	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	1'042	715	0	1'757 EUR	52.81%	927'889.27	0.09	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	889	350	0	1'239 EUR	86.39%	1'070'322.54	0.10	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	830	605	140	1'295 EUR	97.35%	1'260'721.35	0.12	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	705	750	0	1'455 EUR	85.51%	1'244'170.50	0.12	a)
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	3'336	1'545	250	4'631 EUR	99.16%	4'592'053.29	0.44	a)
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	3'164	0	3'164	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	3'176	775	3'951	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	3'585	1'225	0	4'810 EUR	97.22%	4'676'089.60	0.45	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	3'402	1'265	0	4'667 EUR	95.60%	4'461'838.68	0.43	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	3'190	1'190	0	4'380 EUR	95.32%	4'175'191.20	0.40	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	3'435	1'235	0	4'670 EUR	95.27%	4'449'109.00	0.43	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	3'954	1'430	0	5'384 EUR	77.17%	4'154'725.12	0.40	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	2'894	1'440	150	4'184 EUR	94.59%	3'957'645.60	0.38	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	3'037	1'055	0	4'092 EUR	92.98%	3'804'782.52	0.37	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	3'035	1'200	0	4'235 EUR	92.14%	3'902'298.40	0.38	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	3'157	1'080	0	4'237 EUR	90.12%	3'818'257.29	0.37	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	4'171	1'790	0	5'961 EUR	52.71%	3'141'864.27	0.30	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	2'866	1'155	0	4'021 EUR	89.19%	3'586'289.69	0.35	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	3'556	1'255	0	4'811 EUR	88.30%	4'247'872.45	0.41	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	2'484	925	0	3'409 EUR	78.23%	2'666'724.34	0.26	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	2'487	675	0	3'162 EUR	93.32%	2'950'873.26	0.29	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	3'029	995	0	4'024 EUR	87.35%	3'515'004.24	0.34	a)
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	2'673	1'095	0	3'768 EUR	75.98%	2'863'001.76	0.28	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	2'875	1'005	0	3'880 EUR	91.55%	3'552'295.20	0.34	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	3'355	1'240	0	4'595 EUR	86.40%	3'969'942.15	0.38	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	3'173	1'495	0	4'668 EUR	50.30%	2'347'770.60	0.23	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	3'290	1'160	0	4'450 EUR	85.36%	3'798'342.00	0.37	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	2'290	1'480	0	3'770 EUR	83.13%	3'133'925.60	0.30	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	2'988	1'135	100	4'023 EUR	96.63%	3'887'344.44	0.38	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	2'826	1'500	160	4'166 EUR	85.37%	3'556'305.90	0.34	a)
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	2'709	1'025	0	3'734 EUR	99.63%	3'720'109.52	0.36	a)
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	1'452	525	0	1'977 EUR	111.46%	2'203'465.35	0.21	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	1'728	715	0	2'443 EUR	110.80%	2'706'892.86	0.26	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	1'475	500	0	1'975 EUR	109.33%	2'159'168.75	0.21	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	1'228	550	0	1'778 EUR	120.16%	2'136'462.58	0.21	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	2'150	1'040	100	3'090 EUR	119.28%	3'685'597.50	0.36	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	2'685	1'035	100	3'620 EUR	121.63%	4'403'114.60	0.43	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	3'026	1'130	100	4'056 EUR	116.83%	4'738'665.36	0.46	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	2'054	710	0	2'764 EUR	121.57%	3'360'139.52	0.32	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	2'251	839	0	3'090 EUR	128.98%	3'985'605.60	0.39	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	2'030	945	100	2'875 EUR	110.10%	3'165'260.00	0.31	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	3'198	1'325	0	4'523 EUR	99.17%	4'485'278.18	0.43	a)
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	2'507	0	2'507	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	3'293	400	0	3'693 EUR	97.16%	3'588'155.73	0.35	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	2'998	1'025	0	4'023 EUR	96.25%	3'872'137.50	0.37	a)
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	2'555	1'090	200	3'445 EUR	95.30%	3'283'188.35	0.32	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	2'370	790	0	3'160 EUR	94.37%	2'982'155.20	0.29	a)
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	3'191	1'120	0	4'311 EUR	97.40%	4'198'698.45	0.41	a)
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	1'790	0	1'790	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU22015	2.8000 % BKO 2.8 06/12/25	1'910	0	1'910	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	1'410	800	0	2'210 EUR	100.33%	2'217'359.30	0.21	a)
DE000BU22031	3.1000 % BKO 3.1 12/12/25 2Y	1'500	1'230	0	2'730 EUR	100.56%	2'745'369.90	0.27	a)
DE000BU22049	2.5000 % BKO 2 1/2 03/19/26 2Y	0	2'980	250	2'730 EUR	99.97%	2'729'099.10	0.26	a)
DE000BU22056	2.9000 % BKO 2.9 06/18/26	0	2'730	0	2'730 EUR	100.78%	2'751'184.80	0.27	a)
DE000BU22064	2.7000 % BKO 2.7 09/17/26	0	1'435	0	1'435 EUR	100.62%	1'443'853.95	0.14	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	2'595	995	0	3'590 EUR	100.02%	3'590'753.90	0.35	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	2'985	1'250	0	4'235 EUR	100.82%	4'269'557.60	0.41	a)
DE000BU25026	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 189	420	3'470	300	3'590 EUR	99.64%	3'576'896.50	0.35	a)
DE000BU25034	2.5000 % OBL 2 1/2 10/11/29 190	0	1'250	100	1'150 EUR	101.55%	1'167'802.00	0.11	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	1'360	2'230	0	3'590 EUR	101.24%	3'634'551.90	0.35	a)
DE000BU2D004	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/54	0	2'515	0	2'515 EUR	99.52%	2'503'003.45	0.24	a)
DE000BU2F009	2.6000 % DBR 2.6 05/15/41	0	790	0	790 EUR	100.73%	795'751.20	0.08	a)
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	4'032	1'460	0	5'492 EUR	100.78%	5'534'563.00	0.53	a)
DE000BU2Z015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	3'225	1'155	0	4'380 EUR	103.08%	4'514'772.60	0.44	a)
DE000BU2Z023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	350	4'675	0	5'025 EUR	99.60%	5'005'000.50	0.48	a)
DE000BU2Z031	2.6000 % DBR 2.6 08/15/34	0	2'085	0	2'085 EUR	102.83%	2'144'047.20	0.21	a)
DE000BU35025	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 G	0	550	0	550 EUR	99.66%	548'135.50	0.05	a)
DE000BU3Z005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	655	765	125	1'295 EUR	100.77%	1'305'023.30	0.13	a)
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	2'768	1'060	0	3'828 EUR	113.95%	4'361'891.16	0.42	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	2'243	725	0	2'968 EUR	117.01%	3'472'767.76	0.34	a)
ES0000012157	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	2'271	905	0	3'176 EUR	115.11%	3'655'893.60	0.35	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	2'520	500	3'020	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	2'650	890	0	3'540 EUR	105.98%	3'751'798.20	0.36	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	2'600	1'310	160	3'750 EUR	120.14%	4'505'400.00	0.44	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	2'182	745	0	2'927 EUR	109.87%	3'215'865.63	0.31	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	1'698	880	50	2'528 EUR	122.11%	3'087'016.64	0.30	a)
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	2'168	0	2'168	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	2'491	1'205	0	3'696 EUR	95.92%	3'545'129.28	0.34	a)
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	2'785	1'000	200	3'585 EUR	99.24%	3'557'897.40	0.34	a)
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	2'430	945	0	3'375 EUR	98.88%	3'337'065.00	0.32	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	2'095	875	100	2'870 EUR	89.16%	2'558'978.10	0.25	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	1'585	700	0	2'285 EUR	92.14%	2'105'421.85	0.20	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	2'949	1'170	0	4'119 EUR	97.33%	4'009'187.46	0.39	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	2'799	925	0	3'724 EUR	97.28%	3'622'669.96	0.35	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	2'215	1'115	0	3'330 EUR	95.18%	3'169'527.30	0.31	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	2'377	940	125	3'192 EUR	109.56%	3'497'282.88	0.34	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	2'592	1'020	0	3'612 EUR	96.63%	3'490'167.24	0.34	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	2'969	1'050	0	4'019 EUR	95.90%	3'854'301.38	0.37	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	1'975	735	0	2'710 EUR	84.89%	2'300'383.50	0.22	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	2'643	925	0	3'568 EUR	95.61%	3'411'471.84	0.33	a)
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	2'197	1'115	0	3'312 EUR	94.88%	3'142'425.60	0.30	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	2'341	1'095	0	3'436 EUR	88.17%	3'029'383.76	0.29	a)
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	2'796	865	0	3'661 EUR	90.15%	3'300'428.11	0.32	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	2'730	940	0	3'670 EUR	88.64%	3'252'941.20	0.31	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	1'249	0	1'249	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	2'404	845	0	3'249 EUR	55.86%	1'814'891.40	0.18	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	2'480	845	0	3'325 EUR	95.08%	3'161'376.75	0.31	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	2'668	1'515	0	4'183 EUR	91.62%	3'832'380.94	0.37	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	1'929	915	0	2'844 EUR	71.91%	2'045'205.72	0.20	a)
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	2'203	800	0	3'003 EUR	96.25%	2'890'237.35	0.28	a)
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	2'644	1'540	130	4'054 EUR	83.94%	3'402'968.14	0.33	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	843	270	0	1'113 EUR	49.85%	554'774.85	0.05	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	3'014	1'065	0	4'079 EUR	91.63%	3'737'424.54	0.36	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	1'784	575	0	2'359 EUR	74.22%	1'750'849.80	0.17	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	2'458	1'270	0	3'728 EUR	85.18%	3'175'659.52	0.31	a)
ES0000012I07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	1'253	680	0	1'933 EUR	66.83%	1'291'843.23	0.12	a)
ES0000012I15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	2'410	865	0	3'275 EUR	94.00%	3'078'401.75	0.30	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	2'664	1'310	0	3'974 EUR	85.38%	3'392'842.24	0.33	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	2'133	450	2'583	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	1'988	885	0	2'873 EUR	68.66%	1'972'601.80	0.19	a)
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	3'029	910	0	3'939 EUR	91.50%	3'604'263.78	0.35	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	2'464	865	0	3'329 EUR	97.44%	3'243'611.15	0.31	a)
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	1'261	825	100	1'986 EUR	97.91%	1'944'393.30	0.19	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	2'566	920	100	3'386 EUR	100.21%	3'393'246.04	0.33	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	2'594	890	0	3'484 EUR	101.44%	3'534'308.96	0.34	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	1'160	1'265	0	2'425 EUR	105.24%	2'552'021.50	0.25	a)
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	2'656	925	0	3'581 EUR	104.25%	3'733'085.07	0.36	a)
ES0000012M51	3.5000 % SPGB 3 1/2 05/31/29	710	2'585	0	3'295 EUR	103.68%	3'416'124.20	0.33	a)
ES0000012M77	2.5000 % SPGB 2 1/2 05/31/27	400	2'525	0	2'925 EUR	99.71%	2'916'605.25	0.28	a)
ES0000012M85	3.2500 % SPGB 3 1/4 04/30/34	1'200	2'450	130	3'520 EUR	101.57%	3'575'123.20	0.35	a)
ES0000012M93	4.0000 % SPGB 4 10/31/54	0	1'130	0	1'130 EUR	103.61%	1'170'793.00	0.11	a)
ES0000012N35	3.4500 % SPGB 3.45 10/31/34	0	2'680	0	2'680 EUR	102.95%	2'759'140.40	0.27	a)
ES0000012N43	3.1000 % SPGB 3 1 07/30/31	0	550	100	450 EUR	101.74%	457'821.00	0.04	a)
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25 15Y	575	0	575	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28 16Y	687	75	0	762 EUR	101.07%	770'153.40	0.07	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42 30Y	603	210	0	813 EUR	94.40%	767'472.00	0.07	a)
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31 16Y	459	250	0	709 EUR	88.85%	629'939.41	0.06	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25 10Y	484	0	100	384 EUR	98.02%	376'408.32	0.04	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26 10Y	827	0	0	827 EUR	96.75%	800'114.23	0.08	a)
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	619	250	0	869 EUR	73.09%	635'178.17	0.06	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27 10Y	637	300	0	937 EUR	94.40%	884'565.48	0.09	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34 16Y	441	250	0	691 EUR	86.29%	596'277.72	0.06	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28 10Y	862	230	0	1'092 EUR	92.49%	1'009'968.96	0.10	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29 10Y	635	280	0	915 EUR	90.52%	828'267.15	0.08	a)
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36 16Y	540	250	0	790 EUR	72.80%	575'135.80	0.06	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40 20Y	448	200	0	648 EUR	64.87%	420'364.08	0.04	a)
FI4000441878	0.0000 % RFGB 0 09/15/30 10Y	625	150	0	775 EUR	85.80%	664'965.50	0.06	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52 31Y	492	120	0	612 EUR	47.22%	289'004.76	0.03	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31 10Y	749	180	0	929 EUR	84.37%	783'825.17	0.08	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26 5Y	382	540	0	922 EUR	95.03%	876'195.04	0.08	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43 21Y	451	175	0	626 EUR	63.98%	400'496.02	0.04	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32 10Y	648	250	0	898 EUR	91.52%	821'876.54	0.08	a)
FI4000527551	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/27 4Y	405	215	0	620 EUR	97.22%	602'745.40	0.06	a)
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38 15Y	421	100	0	521 EUR	97.20%	506'412.00	0.05	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33 10Y	650	490	0	1'140 EUR	102.08%	1'163'666.40	0.11	a)
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	280	530	0	810 EUR	101.50%	822'166.20	0.08	a)
FI4000566294	2.9500 % RFGB 2.95 04/15/55 31Y	315	305	0	620 EUR	97.71%	605'808.20	0.06	a)
FI4000571104	3.0000 % RFGB 3 09/15/34 10Y	0	760	0	760 EUR	101.69%	772'844.00	0.07	a)
FI4000577952	2.5000 % RFGB 2 1/2 04/15/30	0	575	0	575 EUR	99.74%	573'522.25	0.06	a)
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32 OAT	3'684	1'480	110	5'054 EUR	120.87%	6'108'769.80	0.59	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25 OAT	3'161	819	0	3'980 EUR	103.50%	4'119'097.14	0.40	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29 OAT	4'246	2'030	140	6'136 EUR	112.13%	6'880'296.80	0.66	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35 OAT	3'088	1'080	0	4'168 EUR	115.64%	4'819'875.20	0.47	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55 OAT	2'106	1'285	140	3'251 EUR	108.77%	3'536'112.70	0.34	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38 OAT	2'777	1'085	50	3'812 EUR	108.99%	4'154'670.46	0.40	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41 OAT	3'972	1'650	100	5'522 EUR	115.46%	6'375'701.20	0.62	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60 OAT	2'063	1'025	0	3'088 EUR	109.75%	3'389'080.00	0.33	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26 OAT	4'619	1'730	0	6'349 EUR	101.33%	6'433'441.70	0.62	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27 OAT	6'084	2'900	100	8'884 EUR	100.48%	8'926'643.20	0.86	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45 OAT	3'194	1'515	160	4'549 EUR	98.10%	4'462'569.00	0.43	a)
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30 OAT	6'529	3'045	340	9'234 EUR	99.12%	9'152'740.80	0.88	a)
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25 OAT	4'377	0	4'377	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25 OAT	3'965	1'705	300	5'370 EUR	97.88%	5'256'156.00	0.51	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31 OAT	6'472	3'270	250	9'492 EUR	92.64%	8'793'388.80	0.85	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26 OAT	5'322	2'020	0	7'342 EUR	96.45%	7'081'359.00	0.68	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66 OAT	1'793	850	0	2'643 EUR	63.56%	1'679'890.80	0.16	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36 OAT	4'927	1'980	150	6'757 EUR	82.05%	5'544'118.50	0.54	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26 OAT	4'162	1'515	0	5'677 EUR	94.98%	5'392'014.60	0.52	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 OAT	3'494	1'640	0	5'134 EUR	82.99%	4'260'706.60	0.41	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27 OAT	4'366	2'275	130	6'511 EUR	95.90%	6'244'049.00	0.60	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48 OAT	3'188	1'215	0	4'403 EUR	77.15%	3'396'914.50	0.33	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28 OAT	6'624	2'875	290	9'209 EUR	93.55%	8'615'019.50	0.83	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34 OAT	4'846	3'820	340	8'326 EUR	85.81%	7'144'540.60	0.69	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28 OAT	6'195	2'305	0	8'500 EUR	92.63%	7'873'550.00	0.76	a)
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50 OAT	3'468	1'400	100	4'768 EUR	67.26%	3'206'956.80	0.31	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29 OAT	6'035	2'410	0	8'445 EUR	90.60%	7'651'170.00	0.74	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25 OAT	4'935	0	4'935	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29 OAT	4'966	1'860	0	6'826 EUR	87.26%	5'956'367.60	0.58	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52 OAT	3'587	1'290	50	4'827 EUR	52.58%	2'538'036.60	0.25	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26 OAT	4'783	1'965	200	6'548 EUR	96.12%	6'293'937.60	0.61	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	2'770	1'245	0	4'015 EUR	66.26%	2'660'339.00	0.26	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30 OAT	6'005	2'220	0	8'225 EUR	84.78%	6'973'155.00	0.67	a)
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072 OAT	1'383	515	0	1'898 EUR	36.62%	695'047.60	0.07	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44 OAT	2'353	850	0	3'203 EUR	59.32%	1'900'019.60	0.18	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31 OAT	5'657	2'790	100	8'347 EUR	82.18%	6'859'564.60	0.66	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27 OAT	4'366	2'230	0	6'596 EUR	93.86%	6'191'005.60	0.60	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53 OAT	3'280	1'520	0	4'800 EUR	51.24%	2'459'520.00	0.24	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32 OAT	3'946	1'925	0	5'871 EUR	80.83%	4'745'529.30	0.46	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25 OAT	2'253	0	2'253	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 OAT	1'911	2'385	0	4'296 EUR	78.37%	3'366'775.20	0.33	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28 OAT	5'291	1'835	0	7'126 EUR	93.96%	6'695'589.60	0.65	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32 OAT	4'892	2'085	0	6'977 EUR	93.91%	6'552'100.70	0.63	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43 OAT	1'420	1'610	0	3'030 EUR	88.01%	2'666'703.00	0.26	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54 OAT	2'540	1'190	0	3'730 EUR	90.48%	3'374'904.00	0.33	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26 OAT	4'970	2'095	100	6'965 EUR	99.76%	6'948'284.00	0.67	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33 OAT	4'066	2'040	0	6'106 EUR	100.93%	6'162'611.19	0.60	a)
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29 OAT	3'931	3'750	0	7'681 EUR	100.41%	7'712'492.10	0.75	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33 OAT	2'085	4'800	100	6'785 EUR	104.64%	7'099'824.00	0.69	a)
FR001400NBC6	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/27 OAT	500	3'610	100	4'010 EUR	99.74%	3'999'574.00	0.39	a)
FR001400NEF3	3.0000 % FRTR 3 06/25/49 OAT	825	310	0	1'135 EUR	93.15%	1'057'252.50	0.10	a)
FR001400OHF4	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/55 OAT	0	2'065	0	2'065 EUR	94.47%	1'950'805.50	0.19	a)
FR001400PM68	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/30 OAT	0	2'590	0	2'590 EUR	100.27%	2'596'993.00	0.25	a)
FR001400QMF9	3.0000 % FRTR 3 11/25/34 OAT	0	2'160	150	2'010 EUR	100.02%	2'010'402.00	0.19	a)
IE000GLVBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	448	100	0	548 EUR	100.66%	551'616.80	0.05	a)
IE000LQ7YWY4	2.6000 % IRISH 2.6 10/18/34	0	600	0	600 EUR	99.58%	597'480.00	0.06	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	1'296	0	1'296	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDP44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	836	380	0	1'216 EUR	94.88%	1'153'740.80	0.11	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	550	150	0	700 EUR	90.48%	633'360.00	0.06	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	727	255	0	982 EUR	93.40%	917'188.00	0.09	a)
IE00BH35Q895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	1'069	400	0	1'469 EUR	94.33%	1'385'707.70	0.13	a)
IE00BH35QB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	968	300	0	1'268 EUR	73.61%	933'374.80	0.09	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	1'032	320	0	1'352 EUR	99.88%	1'350'377.60	0.13	a)
IE00BKFCV345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	534	300	0	834 EUR	78.41%	653'939.40	0.06	a)
IE00BKFCV568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	826	280	0	1'106 EUR	94.34%	1'043'400.40	0.10	a)
IE00BKFCV899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	925	235	0	1'160 EUR	87.39%	1'013'724.00	0.10	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	554	195	0	749 EUR	84.09%	629'834.10	0.06	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	969	310	0	1'279 EUR	83.94%	1'073'592.60	0.10	a)
IE00BMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	416	235	0	651 EUR	69.23%	450'687.30	0.04	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	1'150	460	0	1'610 EUR	85.23%	1'372'203.00	0.13	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	1'163	350	0	1'513 EUR	97.40%	1'473'662.00	0.14	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	805	290	0	1'095 EUR	88.48%	968'856.00	0.09	a)
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	1'341	445	0	1'786 EUR	109.29%	1'951'990.84	0.19	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	2'917	1'170	100	3'987 EUR	111.07%	4'428'400.77	0.43	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	3'301	1'225	100	4'426 EUR	110.45%	4'888'339.96	0.47	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	3'463	1'280	110	4'633 EUR	116.41%	5'393'275.30	0.52	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	2'925	845	0	3'770 EUR	116.35%	4'386'357.30	0.42	a)
IT0003353157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	2'830	1'305	170	3'965 EUR	111.41%	4'417'525.45	0.43	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	3'436	1'290	0	4'726 EUR	102.42%	4'840'227.42	0.47	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	2'703	1'115	0	3'818 EUR	111.27%	4'248'326.78	0.41	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	2'652	0	2'652	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	2'414	1'185	100	3'499 EUR	111.08%	3'886'794.17	0.38	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	2'441	930	0	3'371 EUR	102.36%	3'450'555.60	0.33	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	2'559	1'260	0	3'819 EUR	106.76%	4'077'317.16	0.39	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	2'073	870	0	2'943 EUR	108.34%	3'188'299.05	0.31	a)
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	3'143	1'160	110	4'193 EUR	102.06%	4'279'291.94	0.41	a)
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	1'871	845	0	2'716 EUR	87.55%	2'377'722.20	0.23	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	2'244	500	2'744	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	2'753	1'190	0	3'943 EUR	88.93%	3'506'470.47	0.34	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	2'123	810	0	2'933 EUR	98.94%	2'901'792.88	0.28	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	1'960	730	0	2'690 EUR	79.52%	2'139'195.60	0.21	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	2'427	830	0	3'257 EUR	97.98%	3'191'110.89	0.31	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	1'858	610	0	2'468 EUR	85.46%	2'109'177.48	0.20	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	2'177	750	0	2'927 EUR	96.74%	2'831'638.34	0.27	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	1'038	345	0	1'383 EUR	73.75%	1'019'934.84	0.10	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	2'073	770	0	2'843 EUR	92.00%	2'615'588.43	0.25	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	2'148	705	0	2'853 EUR	98.48%	2'809'577.34	0.27	a)
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	1'937	855	150	2'642 EUR	89.75%	2'371'168.58	0.23	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	1'969	790	0	2'759 EUR	97.92%	2'701'667.98	0.26	a)
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	1'593	700	0	2'293 EUR	89.71%	2'056'935.65	0.20	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	2'604	955	0	3'559 EUR	97.27%	3'461'839.30	0.33	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	1'833	0	1'833	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	2'307	905	0	3'212 EUR	99.50%	3'195'940.00	0.31	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	1'988	790	0	2'778 EUR	99.55%	2'765'443.44	0.27	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	1'621	1'150	0	2'771 EUR	97.16%	2'692'275.89	0.26	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	1'683	920	0	2'603 EUR	94.95%	2'471'496.44	0.24	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	2'394	905	0	3'299 EUR	99.82%	3'293'094.79	0.32	a)
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	1'904	648	0	2'552 EUR	98.75%	2'520'048.96	0.24	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	1'621	420	0	2'041 EUR	89.69%	1'830'552.49	0.18	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	2'462	805	0	3'267 EUR	90.95%	2'971'238.49	0.29	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	1'412	0	1'412	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	2'149	700	0	2'849 EUR	95.64%	2'724'755.11	0.26	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	1'767	795	145	2'417 EUR	73.24%	1'770'089.95	0.17	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	1'404	805	0	2'209 EUR	78.74%	1'739'300.33	0.17	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	2'162	550	0	2'712 EUR	88.03%	2'387'400.72	0.23	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	1'840	355	2'195	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	2'460	960	100	3'320 EUR	91.10%	3'024'486.80	0.29	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	2'302	790	0	3'092 EUR	94.64%	2'926'299.72	0.28	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	2'026	780	0	2'806 EUR	96.74%	2'714'412.16	0.26	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	1'749	780	0	2'529 EUR	73.32%	1'854'338.67	0.18	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	2'639	1'090	0	3'729 EUR	86.14%	3'212'197.89	0.31	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	1'720	775	0	2'495 EUR	61.50%	1'534'474.90	0.15	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	1'845	670	0	2'515 EUR	71.86%	1'807'304.15	0.17	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	2'001	770	0	2'771 EUR	91.27%	2'529'036.28	0.24	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	2'263	845	50	3'058 EUR	83.50%	2'553'521.74	0.25	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	1'960	1'025	0	2'985 EUR	95.65%	2'855'242.05	0.28	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	1'413	605	0	2'018 EUR	64.54%	1'302'376.84	0.13	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	729	370	0	1'099 EUR	61.26%	673'203.44	0.07	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	1'688	680	0	2'368 EUR	91.31%	2'162'268.16	0.21	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	2'219	725	0	2'944 EUR	84.84%	2'497'630.72	0.24	a)
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	1'995	670	0	2'665 EUR	94.83%	2'527'246.15	0.24	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	2'252	735	0	2'987 EUR	83.62%	2'497'580.05	0.24	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	1'764	530	0	2'294 EUR	89.52%	2'053'634.68	0.20	a)
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	955	350	0	1'305 EUR	67.02%	874'650.15	0.08	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	1'518	937	0	2'455 EUR	95.79%	2'351'718.15	0.23	a)
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	1'720	260	1'980	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	2'060	835	160	2'735 EUR	93.40%	2'554'353.25	0.25	a)
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	1'887	380	0	2'267 EUR	98.90%	2'242'153.68	0.22	a)
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	1'300	605	0	1'905 EUR	93.13%	1'774'183.65	0.17	a)
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	1'825	730	0	2'555 EUR	99.46%	2'541'151.90	0.25	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	1'288	645	0	1'933 EUR	102.97%	1'990'410.10	0.19	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	1'800	690	0	2'490 EUR	100.76%	2'508'924.00	0.24	a)
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	2'199	965	0	3'164 EUR	106.78%	3'378'645.76	0.33	a)
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	2'026	1'325	0	3'351 EUR	103.53%	3'469'156.26	0.34	a)
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	1'920	710	0	2'630 EUR	101.71%	2'674'946.70	0.26	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	1'005	920	0	1'925 EUR	103.91%	2'000'229.00	0.19	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	1'525	555	0	2'080 EUR	103.58%	2'154'547.20	0.21	a)
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	1'605	0	1'605	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	1'820	535	0	2'355 EUR	101.46%	2'389'312.35	0.23	a)
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	1'004	610	0	1'614 EUR	104.44%	1'685'645.46	0.16	a)
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	1'607	855	120	2'342 EUR	102.61%	2'403'079.36	0.23	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	2'065	980	0	3'045 EUR	106.19%	3'233'576.85	0.31	a)
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	1'845	685	0	2'530 EUR	103.14%	2'609'517.90	0.25	a)
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	1'885	750	0	2'635 EUR	102.01%	2'688'068.90	0.26	a)
IT0005557084	3.6000 % BTPS 3.6 09/29/25 2Y	1'305	700	0	2'005 EUR	100.57%	2'016'468.60	0.19	a)
IT0005560948	4.2000 % BTPS 4.2 03/01/34 10Y	2'025	920	50	2'895 EUR	104.84%	3'035'126.97	0.29	a)
IT0005561888	4.0000 % BTPS 4 11/15/30 7Y	1'465	920	0	2'385 EUR	104.18%	2'484'708.98	0.24	a)
IT0005566408	4.1000 % BTPS 4.1 02/01/29 5Y	990	1'540	0	2'530 EUR	104.46%	2'642'711.50	0.26	a)
IT0005580045	2.9500 % BTPS 2.95 02/15/27 3Y	600	1'885	0	2'485 EUR	100.29%	2'492'131.95	0.24	a)
IT0005580094	3.5000 % BTPS 3 1/2 02/15/31 7Y	250	2'220	0	2'470 EUR	101.22%	2'500'109.30	0.24	a)
IT0005582421	4.1500 % BTPS 4.15 10/01/39 15Y	0	1'955	0	1'955 EUR	101.50%	1'984'364.10	0.19	a)
IT0005584302	3.2000 % BTPS 3.2 01/28/26 2Y	0	2'255	0	2'255 EUR	100.34%	2'262'599.35	0.22	a)
IT0005584849	3.3500 % BTPS 3.35 07/01/29 5Y	0	2'745	0	2'745 EUR	101.25%	2'779'175.25	0.27	a)
IT0005584856	3.8500 % BTPS 3.85 07/01/34 10Y	0	2'805	0	2'805 EUR	101.71%	2'853'077.70	0.28	a)
IT0005595803	3.4500 % BTPS 3.45 07/15/31 7Y	0	1'420	0	1'420 EUR	100.71%	1'430'096.20	0.14	a)
IT0005596470	4.0500 % BTPS 4.05 10/30/37 13Y	0	1'540	250	1'290 EUR	101.93%	1'314'922.80	0.13	a)
IT0005599904	3.4500 % BTPS 3.45 07/15/27 3Y	0	1'050	0	1'050 EUR	101.63%	1'067'094.00	0.10	a)
IT0005607269	3.1000 % BTPS 3.1 08/28/26 2Y	0	500	0	500 EUR	100.45%	502'235.00	0.05	a)
IT0005607970	3.8500 % BTPS 3.85 02/01/35 11Y	0	840	0	840 EUR	101.22%	850'256.40	0.08	a)
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	1'974	710	100	2'584 EUR	113.80%	2'940'023.00	0.28	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	1'395	475	0	1'870 EUR	110.02%	2'057'374.00	0.20	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	1'954	750	0	2'704 EUR	113.62%	3'072'398.42	0.30	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	1'601	625	0	2'226 EUR	100.12%	2'228'170.60	0.22	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	2'168	830	50	2'948 EUR	100.36%	2'958'311.72	0.29	a)
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	1'893	200	2'093	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	1'968	590	150	2'408 EUR	96.55%	2'324'924.00	0.22	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	1'890	655	0	2'545 EUR	95.65%	2'434'292.50	0.24	a)
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	2'021	755	0	2'776 EUR	94.17%	2'614'159.20	0.25	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	1'328	425	0	1'753 EUR	90.44%	1'585'413.20	0.15	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	1'689	565	0	2'254 EUR	72.24%	1'628'289.60	0.16	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	1'589	425	0	2'014 EUR	87.10%	1'754'194.00	0.17	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	1'579	585	0	2'164 EUR	84.89%	1'837'019.60	0.18	a)
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	1'132	895	0	2'027 EUR	69.77%	1'414'237.90	0.14	a)
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	1'347	1'020	0	2'367 EUR	90.30%	2'137'401.00	0.21	a)
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	1'612	390	400	1'602 EUR	96.60%	1'547'532.00	0.15	a)
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	1'420	535	0	1'955 EUR	86.14%	1'684'037.00	0.16	a)
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	890	1'110	40	1'960 EUR	85.48%	1'675'408.00	0.16	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	1'295	450	0	1'745 EUR	99.91%	1'743'429.50	0.17	a)
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	915	840	0	1'755 EUR	100.54%	1'764'477.00	0.17	a)
NL0015001RG8	3.2500 % NETHER 3 1/4 01/15/44	520	810	0	1'330 EUR	107.28%	1'426'784.10	0.14	a)
NL0015001XZ6	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/34	0	1'560	0	1'560 EUR	99.44%	1'551'264.00	0.15	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	1'636	500	0	2'136 EUR	94.63%	2'021'296.80	0.20	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	1'895	660	0	2'555 EUR	48.97%	1'251'183.50	0.12	a)

EUR 1'025'548'453.51 99.08

#### Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

#### Devisentermingeschäfte

CHF/EUR Verfall 27.08.2024	380'054	360'000	EUR/CHF	0.00	0.00
----------------------------	---------	---------	---------	------	------

#### Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
<b>Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)</b>									
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		14'336'551	15'075'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024		12'000	11'425		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		46'897	49'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		25'940'565	26'840'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024		41'952'000	40'810'906		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		40'214'142	41'427'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		33'105	34'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		1'675'743	1'716'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		98'874'450	101'360'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.05.2024		144'537'000	141'754'663		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.06.2024		139'022'106	142'083'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.06.2024		835'000	813'594		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.06.2024		71'000	69'420		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.06.2024		124'000	122'212		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.06.2024		141'053'000	138'133'203		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		159'916'293	163'621'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		71'017	73'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.07.2024		1'111'000	1'061'393		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.07.2024		713'000	680'224		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.07.2024		649'000	621'783		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.07.2024		161'221'000	155'255'823		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		158'034'431	164'521'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		527'394	545'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		62'022	64'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		153'200	157'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		114'142	118'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		1'828'237	1'907'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		1'232'500	1'286'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.08.2024		168'598'000	160'589'595		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.09.2024		164'659'947	173'238'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.09.2024		243'484	260'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.09.2024		350'292	370'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.09.2024		2'067'509	2'201'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.10.2024		176'069'000	165'346'398		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.10.2024		165'483'739	176'587'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert EUR	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	532'730.15	0.05
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'025'548'453.51	99.08
Sonstige Vermögenswerte	9'031'361.89	0.87
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'035'112'545.55</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-55'654'985.60	
Andere Verbindlichkeiten	-6'239.06	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>979'451'320.89</b>	

Bewertungskategorien	Kurswert EUR	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);	1'025'548'453.51	99.08
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	Kurswert EUR	in % 7)
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>282'659'939.15</b>	<b>27.31</b>
AT0000383864 6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	1'279 EUR 110.25%	1'410'084.71 0.14
AT0000A1K9C8 0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	2'100 EUR 96.36%	2'023'476.00 0.20
AT0000A1ZGE4 0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	1'824 EUR 94.31%	1'720'214.40 0.17
AT0000A269M8 0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	2'045 EUR 91.64%	1'874'038.00 0.18



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	1'900 EUR	87.08%	1'654'520.00	0.16	
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	649 EUR	61.41%	398'550.90	0.04	
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	298 EUR	84.52%	251'869.60	0.02	
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	1'700 EUR	88.11%	1'497'870.00	0.14	
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	500 EUR	101.73%	508'650.00	0.05	
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	600 EUR	104.72%	628'344.00	0.06	
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	2'270 EUR	97.31%	2'208'710.22	0.21	
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	2'207 EUR	95.58%	2'109'450.60	0.20	
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	1'300 EUR	99.88%	1'298'440.00	0.13	
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	1'350 EUR	97.19%	1'312'119.00	0.13	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	4'300 EUR	99.16%	4'263'837.00	0.41	
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	3'200 EUR	97.22%	3'110'912.00	0.30	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	4'372 EUR	95.60%	4'179'806.88	0.40	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	500 EUR	95.32%	476'620.00	0.05	
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	3'000 EUR	95.27%	2'858'100.00	0.28	
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	3'446 EUR	77.17%	2'658'823.44	0.26	
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	2'500 EUR	94.59%	2'364'750.00	0.23	
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	3'500 EUR	92.14%	3'225'040.00	0.31	
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	3'000 EUR	90.12%	2'703'510.00	0.26	
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	3'700 EUR	89.19%	3'299'993.00	0.32	
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	3'000 EUR	88.30%	2'648'850.00	0.26	
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	3'000 EUR	78.23%	2'346'780.00	0.23	
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	2'400 EUR	93.32%	2'239'752.00	0.22	
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	2'400 EUR	87.35%	2'096'424.00	0.20	
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	300 EUR	75.98%	227'946.00	0.02	
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	3'500 EUR	91.55%	3'204'390.00	0.31	
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	2'500 EUR	86.40%	2'159'925.00	0.21	
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	3'800 EUR	96.63%	3'671'864.00	0.35	
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	3'519 EUR	99.63%	3'505'909.32	0.34	
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	1'800 EUR	109.33%	1'967'850.00	0.19	
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	2'890 EUR	119.28%	3'447'047.50	0.33	
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	3'400 EUR	116.83%	3'972'254.00	0.38	
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	2'500 EUR	121.57%	3'039'200.00	0.29	
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	3'100 EUR	97.16%	3'011'991.00	0.29	
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	3'000 EUR	96.25%	2'887'500.00	0.28	
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	4'000 EUR	100.82%	4'032'640.00	0.39	
DE000BU22007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	3'800 EUR	100.78%	3'829'450.00	0.37	
DE000BU22015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	4'100 EUR	103.08%	4'226'157.00	0.41	
DE000BU22023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	2'980 EUR	99.60%	2'968'139.60	0.29	
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	3'585 EUR	99.24%	3'557'897.40	0.34	
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	2'935 EUR	95.18%	2'793'562.35	0.27	
ES0000012124	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	1'525 EUR	74.22%	1'131'855.00	0.11	
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28 16Y	650 EUR	101.07%	656'955.00	0.06	
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26 10Y	827 EUR	96.75%	800'114.23	0.08	
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32 OAT	3'180 EUR	120.87%	3'843'666.00	0.37	
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25 OAT	3'800 EUR	103.50%	3'933'000.00	0.38	
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29 OAT	1'500 EUR	112.13%	1'681'950.00	0.16	
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35 OAT	3'150 EUR	115.64%	3'642'660.00	0.35	
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38 OAT	2'500 EUR	108.99%	2'724'750.00	0.26	
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41 OAT	4'100 EUR	115.46%	4'733'860.00	0.46	
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27 OAT	8'384 EUR	100.48%	8'424'243.20	0.81	
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30 OAT	950 EUR	99.12%	941'640.00	0.09	
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25 OAT	3'900 EUR	97.88%	3'817'320.00	0.37	
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26 OAT	6'500 EUR	96.45%	6'269'250.00	0.61	
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36 OAT	4'941 EUR	82.05%	4'054'090.50	0.39	
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26 OAT	5'300 EUR	94.98%	5'033'940.00	0.49	
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 OAT	4'834 EUR	82.99%	4'011'736.60	0.39	
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27 OAT	5'900 EUR	95.90%	5'658'100.00	0.55	
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28 OAT	8'400 EUR	93.55%	7'858'200.00	0.76	
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34 OAT	7'700 EUR	85.81%	6'607'370.00	0.64	
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28 OAT	7'975 EUR	92.63%	7'387'242.50	0.71	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert EUR	in % (7)	Kat.
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29 OAT	7'901 EUR	90.60%	7'158'306.00	0.69	
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29 OAT	786 EUR	87.26%	685'863.60	0.07	
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52 OAT	4'500 EUR	52.58%	2'366'100.00	0.23	
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26 OAT	5'980 EUR	96.12%	5'747'976.00	0.56	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	3'630 EUR	66.26%	2'405'238.00	0.23	
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30 OAT	7'635 EUR	84.78%	6'472'953.00	0.63	
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31 OAT	7'400 EUR	82.18%	6'081'320.00	0.59	
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27 OAT	4'600 EUR	93.86%	4'317'560.00	0.42	
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32 OAT	5'000 EUR	80.83%	4'041'500.00	0.39	
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28 OAT	6'600 EUR	93.96%	6'201'360.00	0.60	
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32 OAT	4'800 EUR	93.91%	4'507'680.00	0.44	
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26 OAT	6'480 EUR	99.76%	6'464'448.00	0.62	
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33 OAT	5'700 EUR	100.93%	5'753'010.00	0.56	
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29 OAT	6'800 EUR	100.41%	6'827'880.00	0.66	
FR001400QMF9	3.0000 % FRTR 3 11/25/34 OAT	950 EUR	100.02%	950'190.00	0.09	
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	1'129 EUR	83.94%	947'682.60	0.09	
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	1'500 EUR	97.40%	1'461'000.00	0.14	
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	2'090 EUR	100.12%	2'092'508.00	0.20	
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	2'408 EUR	96.55%	2'324'924.00	0.22	
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	2'460 EUR	95.65%	2'352'990.00	0.23	
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	2'500 EUR	94.17%	2'354'250.00	0.23	
NL001352060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	2'180 EUR	72.24%	1'574'832.00	0.15	
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	283 EUR	87.10%	246'493.00	0.02	
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	1'870 EUR	69.77%	1'304'699.00	0.13	
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	2'100 EUR	90.30%	1'896'300.00	0.18	
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	1'770 EUR	86.14%	1'524'678.00	0.15	
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	1'770 EUR	85.48%	1'512'996.00	0.15	

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

CHF 1 = EUR 1.06478873

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	EUR	119'447'995.21	39.545
Bond	EUR	180'592'266.48	59.788
Index bond	EUR	2'011'857.91	0.666
Total	EUR	302'052'119.60	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)	EUR	176'205'220.50	17.990
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	-	-

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

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA EUR	EUR	0.00 - 0.10	-	0.055	-	-	-
FAH1 CHF	EUR	0.00 - 0.10	-	0.055	-	-	-
GT EUR	EUR	0.00 - 0.10	-	0.055	-	-	-
NT EUR	EUR	0.00 - 0.10	-	0.055	-	-	-
NTH1 CHF	EUR	0.00 - 0.10	-	0.055	-	-	-

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	EUR	282'659'939.15
Andere Wertpapiere	EUR	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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:** 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
FA EUR	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
FAH1 CHF	0.200	0.550	0.100	0.100	3.000
GT EUR	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT EUR	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

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

FTSE EMU Government Bond Index TR

## 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 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 Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des 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 oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem 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 Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.