

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND USA 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»

Klasse	Valor	Währung
FA USD	31562127	USD
GT USD	56649814	USD
NT USD	11704519	USD

Rechnungswährung: USD

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	12
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Fussnoten	15
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

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
Konsolidiert					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		609'404'327.77	543'083'008.31	504'098'548.63	362'152'358.10
Klasse FA USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'874'019.57	17'020'018.57	13'964'357.57	2'630'837.11
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		243'419.125	192'572.597	158'431.709	26'334.664
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.8615	88.3823	88.1412	99.9002
Ausschüttung je Anteil		-	2.10	1.65	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse GT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		42'551'861.88	34'339'036.47	59'194'992.54	5'807'979.85
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		484'347.580	403'652.675	706'459.225	61'995.225
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.8540	85.0708	83.7911	93.6843
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		74.5397	74.9091	78.5332	85.9507
Thesaurierung je Anteil		-	2.05	1.58	1.62
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		544'978'446.32	491'723'953.27	430'939'198.52	353'713'541.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'718'222.096	4'397'436.312	3'916'257.870	2'877'456.055
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		115.5050	111.8206	110.0385	122.9258
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		98.0003	98.4636	103.1336	112.7783
Thesaurierung je Anteil		-	2.85	2.24	2.30
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 USD	4.11 %	4.13 %	-12.63 %	-2.43 %
Klasse GT USD (Lancierung 08.09.2020)	4.14 %	4.18 %	-12.59 %	-2.39 %
Klasse NT USD	4.21 %	4.32 %	-12.47 %	-2.25 %
Benchmark	4.26 %	4.28 %	-12.61 %	-2.30 %
Tracking Error 33)	-	0.08 %	0.09 %	0.04 %

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 USD	-0.15 %
Klasse GT USD (Lancierung 08.09.2020)	-0.12 %
Klasse NT USD	-0.05 %

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	105'025.48	1'407'668.67
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	606'988'505.81	538'588'575.35
Sonstige Vermögenswerte	4'146'754.30	3'092'945.18
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	611'240'285.59	543'089'189.20
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'828'668.31	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-7'289.51	-6'180.89
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	609'404'327.77	543'083'008.31

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA USD	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		192'572.597	158'431.709
Ausgegebene Anteile		82'547.179	117'642.453
Zurückgenommene Anteile		-31'700.651	-83'501.565
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		243'419.125	192'572.597

Klasse GT USD	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		403'652.675	706'459.225
Ausgegebene Anteile		107'474.630	439'828.772
Zurückgenommene Anteile		-26'779.725	-742'635.322
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		484'347.580	403'652.675

Klasse NT USD	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'397'436.312	3'916'257.870
Ausgegebene Anteile		391'714.384	3'410'408.550
Zurückgenommene Anteile		-70'928.600	-2'929'230.108
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'718'222.096	4'397'436.312

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		543'083'008.31	504'098'548.63
Ausbezahlte Ausschüttung		-482'887.98	-279'409.62
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-4'833'371.93	-4'004'712.52
Saldo aus dem Anteilverkehr		47'632'959.24	34'897'467.00
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		24'004'620.13	8'371'114.82
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		609'404'327.77	543'083'008.31

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		35'954.31	97'235.33
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		8'356'079.71	14'799'219.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		571'318.88	3'409'344.50
Total Ertrag		8'963'352.90	18'305'799.06
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-3.72
Reglementarische Vergütungen		-41'480.32	-77'367.94
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-112'809.74	-4'442'228.56
Total Aufwand		-154'290.06	-4'519'600.22
Nettoertrag / Verlust		8'809'062.84	13'786'198.84
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-897'066.95	-23'796'538.01
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		45'885.12	281'332.81
Realisierter Erfolg		7'957'881.01	-9'729'006.36
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		16'046'739.12	18'100'121.18
Gesamterfolg		24'004'620.13	8'371'114.82

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 USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							606'988'505.81	99.30	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							606'988'505.81	99.30	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	351	0	0	351 USD	102.58%	360'049.20	0.06	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	441	0	0	441 USD	106.88%	471'318.75	0.08	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	430	0	0	430 USD	105.66%	454'321.88	0.07	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	398	0	0	398 USD	112.41%	447'376.88	0.07	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	500	0	150	350 USD	109.03%	381'609.38	0.06	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	440	0	0	440 USD	105.84%	465'712.50	0.08	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	335	0	0	335 USD	110.33%	369'599.20	0.06	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	315	0	0	315 USD	104.00%	327'600.00	0.05	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	340	100	100	340 USD	105.16%	357'531.25	0.06	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	411	0	0	411 USD	94.08%	386'661.07	0.06	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	612	300	150	762 USD	102.00%	777'240.00	0.13	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	652	0	100	552 USD	104.59%	577'357.50	0.09	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	703	0	100	603 USD	103.19%	622'220.63	0.10	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	704	200	100	804 USD	106.03%	852'491.25	0.14	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	638	0	0	638 USD	103.16%	658'136.88	0.11	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	633	0	0	633 USD	97.03%	614'207.81	0.10	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	627	0	0	627 USD	101.41%	635'817.19	0.10	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	693	0	0	693 USD	107.44%	744'541.88	0.12	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	638	0	0	638 USD	102.59%	654'548.13	0.11	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	425	200	0	625 USD	94.59%	591'210.94	0.10	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	735	0	0	735 USD	86.53%	636'004.69	0.10	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	672	0	0	672 USD	86.09%	578'291.72	0.09	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	649	0	0	649 USD	84.08%	545'667.00	0.09	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	795	0	0	795 USD	80.63%	640'968.75	0.10	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	993	150	0	1'143 USD	80.33%	918'150.41	0.15	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	970	0	0	970 USD	84.81%	822'681.25	0.13	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'480	0	0	1'480 USD	81.31%	1'203'425.00	0.20	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	1'092	0	0	1'092 USD	90.89%	992'525.57	0.16	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	1'150	0	0	1'150 USD	92.44%	1'063'031.25	0.17	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	1'227	0	0	1'227 USD	90.67%	1'112'543.97	0.18	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	1'138	0	0	1'138 USD	87.25%	992'905.00	0.16	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	1'464	250	200	1'514 USD	83.75%	1'267'975.00	0.21	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	1'281	0	150	1'131 USD	81.97%	927'066.56	0.15	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	1'550	0	0	1'550 USD	75.09%	1'163'953.13	0.19	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	831	0	0	831 USD	81.70%	678'952.93	0.11	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	1'134	0	100	1'034 USD	79.86%	825'745.99	0.14	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	669	0	0	669 USD	81.44%	544'816.88	0.09	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	1'377	0	150	1'227 USD	74.22%	910'664.06	0.15	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	1'243	0	0	1'243 USD	73.98%	919'625.84	0.15	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	1'723	0	100	1'623 USD	70.27%	1'140'411.01	0.19	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	778	300	150	928 USD	78.95%	732'684.95	0.12	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	1'433	0	0	1'433 USD	80.56%	1'154'460.63	0.19	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	1'179	100	150	1'129 USD	80.44%	908'139.38	0.15	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'535	100	100	1'535 USD	76.63%	1'176'193.75	0.19	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'696	0	150	1'546 USD	76.45%	1'181'965.24	0.19	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	1'740	450	150	2'040 USD	79.94%	1'630'725.00	0.27	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	1'986	0	0	1'986 USD	81.69%	1'622'313.75	0.27	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	2'131	100	100	2'131 USD	79.72%	1'698'806.56	0.28	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	2'190	275	150	2'315 USD	85.22%	1'972'814.06	0.32	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'364	0	0	2'364 USD	79.56%	1'880'857.50	0.31	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	2'259	250	100	2'409 USD	77.61%	1'869'609.96	0.31	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	2'131	0	0	2'131 USD	68.06%	1'450'411.88	0.24	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	1'999	100	100	1'999 USD	69.86%	1'396'489.01	0.23	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 USD	in % 7)	Kat.
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	2'515	0	0	2'515 USD	64.05%	1'610'779.03	0.26	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'909	350	150	3'109 USD	52.53%	1'633'196.56	0.27	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	3'294	140	75	3'359 USD	54.16%	1'819'108.44	0.30	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	2'423	0	0	2'423 USD	64.13%	1'553'748.75	0.25	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	1'985	0	0	1'985 USD	64.66%	1'283'426.56	0.21	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	3'317	0	0	3'317 USD	57.81%	1'917'640.63	0.31	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	2'670	80	100	2'650 USD	66.38%	1'758'937.50	0.29	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	3'717	150	110	3'757 USD	61.67%	2'317'012.53	0.38	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	3'293	0	0	3'293 USD	71.84%	2'365'814.69	0.39	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	3'660	110	125	3'645 USD	69.38%	2'528'718.75	0.41	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'864	0	0	2'864 USD	75.98%	2'176'192.64	0.36	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'623	110	120	3'613 USD	63.38%	2'289'675.38	0.37	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	3'774	100	150	3'724 USD	69.48%	2'587'598.31	0.42	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'438	300	120	3'618 USD	61.33%	2'218'851.38	0.36	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	3'081	95	0	3'176 USD	72.13%	2'290'690.00	0.37	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'081	100	100	3'081 USD	67.28%	2'072'935.31	0.34	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	2'510	0	0	2'510 USD	76.38%	1'917'012.50	0.31	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	2'934	90	100	2'924 USD	77.27%	2'259'246.73	0.37	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	2'138	150	0	2'288 USD	87.11%	1'993'062.61	0.33	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	2'818	455	150	3'123 USD	79.33%	2'477'417.19	0.41	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	1'900	0	0	1'900 USD	88.47%	1'680'906.25	0.27	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	2'867	0	100	2'767 USD	95.95%	2'655'022.83	0.43	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	1'870	100	0	1'970 USD	96.47%	1'900'434.38	0.31	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	2'767	0	0	2'767 USD	89.70%	2'482'085.33	0.41	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	1'855	125	100	1'880 USD	94.63%	1'778'950.00	0.29	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	2'817	155	150	2'822 USD	89.77%	2'533'185.80	0.41	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	1'825	300	100	2'025 USD	94.41%	1'911'726.56	0.31	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	3'275	100	200	3'175 USD	98.19%	3'117'453.13	0.51	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	2'070	0	0	2'070 USD	100.98%	2'090'376.67	0.34	a)
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	3'100	225	0	3'325 USD	108.94%	3'622'171.88	0.59	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	1'950	170	0	2'120 USD	106.00%	2'247'200.00	0.37	a)
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	1'235	2'185	0	3'420 USD	100.41%	3'433'893.75	0.56	a)
US912810TZ12	4.5000 % T 4 1/2 02/15/44	750	1'355	0	2'105 USD	102.50%	2'157'625.00	0.35	a)
US912810UA42	4.6250 % T 4 5/8 05/15/54	0	3'450	0	3'450 USD	106.91%	3'688'265.63	0.60	a)
US912810UB25	4.6250 % T 4 5/8 05/15/44	0	2'095	0	2'095 USD	104.16%	2'182'073.44	0.36	a)
US912810UC08	4.2500 % T 4 1/4 08/15/54	0	1'250	0	1'250 USD	100.55%	1'256'835.94	0.21	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	2'404	300	0	2'704 USD	95.44%	2'580'630.00	0.42	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	2'285	0	0	2'285 USD	95.70%	2'186'816.29	0.36	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	2'340	0	0	2'340 USD	95.38%	2'231'775.00	0.37	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	3'154	0	0	3'154 USD	96.63%	3'047'552.50	0.50	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	1'305	0	1'305	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	775	0	775	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	3'343	0	0	3'343 USD	96.89%	3'239'053.43	0.53	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	1'425	0	1'425	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'373	0	0	3'373 USD	96.72%	3'262'323.44	0.53	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	1'390	0	325	1'065 USD	98.41%	1'048'026.56	0.17	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	1'280	0	0	1'280 USD	98.59%	1'262'000.00	0.21	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	1'225	0	0	1'225 USD	98.55%	1'207'199.28	0.20	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	2'826	150	0	2'976 USD	97.48%	2'901'330.12	0.47	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	1'400	0	0	1'400 USD	98.34%	1'376'812.50	0.23	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	1'080	0	0	1'080 USD	97.98%	1'058'231.30	0.17	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	1'555	0	0	1'555 USD	97.92%	1'522'685.23	0.25	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	3'128	0	200	2'928 USD	95.38%	2'792'198.50	0.46	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	1'360	0	0	1'360 USD	97.67%	1'328'337.57	0.22	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	1'475	0	0	1'475 USD	97.22%	1'433'976.56	0.23	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	1'075	0	0	1'075 USD	97.34%	1'046'445.31	0.17	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'409	0	0	2'409 USD	94.09%	2'266'718.44	0.37	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	1'460	0	0	1'460 USD	96.84%	1'413'918.75	0.23	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	915	250	0	1'165 USD	96.31%	1'122'040.63	0.18	a)
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	2'386	0	2'386	0 USD	0.00%	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 USD	in % 7)	Kat.
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	2'693	0	0	2'693 USD	97.64%	2'629'461.90	0.43	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	2'300	310	0	2'610 USD	96.50%	2'518'650.00	0.41	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	2'007	0	0	2'007 USD	96.06%	1'927'974.38	0.32	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	2'675	0	0	2'675 USD	96.03%	2'568'835.94	0.42	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	1'890	400	0	2'290 USD	96.25%	2'204'125.00	0.36	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	2'884	0	0	2'884 USD	96.25%	2'775'850.00	0.45	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	2'121	0	2'121	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	1'273	0	0	1'273 USD	96.19%	1'224'274.50	0.20	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	2'220	0	0	2'220 USD	90.58%	2'010'834.26	0.33	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	1'269	0	0	1'269 USD	95.13%	1'207'136.25	0.20	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	755	0	0	755 USD	95.47%	720'789.06	0.12	a)
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	1'228	0	0	1'228 USD	95.30%	1'170'245.69	0.19	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	1'618	0	0	1'618 USD	90.66%	1'466'818.13	0.24	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	1'207	0	0	1'207 USD	95.17%	1'148'724.59	0.19	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	1'396	0	265	1'131 USD	95.34%	1'078'337.81	0.18	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	3'979	0	0	3'979 USD	94.63%	3'765'128.75	0.62	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	2'900	0	0	2'900 USD	88.88%	2'577'375.00	0.42	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	1'013	0	350	663 USD	93.59%	620'526.56	0.10	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	981	0	981	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	1'380	0	275	1'105 USD	92.17%	1'018'499.27	0.17	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	1'955	0	1'955	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	1'413	0	1'413	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'043	0	0	1'043 USD	91.66%	955'974.69	0.16	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	3'711	315	0	4'026 USD	84.00%	3'381'840.00	0.55	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	1'970	0	0	1'970 USD	91.44%	1'801'318.75	0.29	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	1'370	0	1'370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	2'350	0	525	1'825 USD	91.20%	1'664'456.94	0.27	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	1'535	0	1'535	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	1'679	0	1'679	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	2'690	0	0	2'690 USD	90.63%	2'437'812.50	0.40	a)
US912828ZAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	4'806	470	0	5'276 USD	83.34%	4'397'216.25	0.72	a)
US912828ZAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	1'515	350	0	1'865 USD	90.77%	1'692'778.81	0.28	a)
US912828ZAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	1'630	0	0	1'630 USD	96.00%	1'564'800.00	0.26	a)
US912828ZAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	2'616	0	0	2'616 USD	90.17%	2'358'896.38	0.39	a)
US912828ZAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	1'985	0	0	1'985 USD	95.73%	1'900'327.44	0.31	a)
US912828ZAN80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	2'745	0	0	2'745 USD	95.47%	2'620'617.19	0.43	a)
US912828ZAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	1'978	350	0	2'328 USD	90.28%	2'101'747.50	0.34	a)
US912828ZAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	5'512	100	200	5'412 USD	84.06%	4'549'462.50	0.74	a)
US912828ZAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	2'134	350	0	2'484 USD	90.44%	2'246'467.50	0.37	a)
US912828ZAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'475	0	0	2'475 USD	95.34%	2'359'757.81	0.39	a)
US912828ZBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	2'750	0	0	2'750 USD	90.22%	2'481'015.63	0.41	a)
US912828ZBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	2'727	0	0	2'727 USD	95.11%	2'593'632.79	0.42	a)
US912828ZBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	2'845	0	0	2'845 USD	94.88%	2'699'193.75	0.44	a)
US912828ZBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	2'865	200	0	3'065 USD	90.38%	2'769'993.75	0.45	a)
US912828ZBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	5'362	150	200	5'312 USD	85.02%	4'516'029.73	0.74	a)
US912828ZBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	2'730	0	0	2'730 USD	91.38%	2'494'537.50	0.41	a)
US912828ZBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'140	0	0	3'140 USD	94.80%	2'976'622.03	0.49	a)
US912828ZBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	2'410	400	0	2'810 USD	91.59%	2'573'784.38	0.42	a)
US912828ZBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	2'783	0	0	2'783 USD	94.97%	2'642'980.31	0.43	a)
US912828ZBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	2'855	0	0	2'855 USD	94.75%	2'705'112.50	0.44	a)
US912828ZBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	2'720	0	0	2'720 USD	91.42%	2'486'675.14	0.41	a)
US912828ZCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	4'982	270	0	5'252 USD	87.16%	4'577'446.25	0.75	a)
US912828ZCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	2'826	0	0	2'826 USD	91.25%	2'578'725.00	0.42	a)
US912828ZCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	2'839	0	0	2'839 USD	94.55%	2'684'185.92	0.44	a)
US912828ZCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	3'050	0	0	3'050 USD	91.08%	2'777'882.66	0.45	a)
US912828ZCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'538	0	0	2'538 USD	94.58%	2'400'392.69	0.39	a)
US912828ZCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'401	0	0	2'401 USD	93.91%	2'254'689.06	0.37	a)
US912828ZCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	2'979	0	0	2'979 USD	90.02%	2'681'565.32	0.44	a)
US912828ZCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	5'798	0	200	5'598 USD	84.41%	4'725'061.88	0.77	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 USD	in % 7)	Kat.
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	2'585	450	0	3'035 USD	90.30%	2'740'510.31	0.45	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	3'093	0	0	3'093 USD	93.94%	2'905'486.88	0.48	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	2'497	500	0	2'997 USD	90.59%	2'715'094.69	0.44	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	2'565	0	0	2'565 USD	94.02%	2'411'500.65	0.39	a)
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	3'389	0	0	3'389 USD	90.88%	3'080'026.38	0.50	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	2'165	700	0	2'865 USD	94.30%	2'701'605.61	0.44	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	5'427	100	0	5'527 USD	84.66%	4'678'950.94	0.77	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	3'015	0	0	3'015 USD	94.39%	2'845'877.19	0.47	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	2'851	0	0	2'851 USD	91.22%	2'600'737.78	0.43	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	2'913	0	200	2'713 USD	90.58%	2'457'565.55	0.40	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	2'748	0	0	2'748 USD	94.27%	2'590'419.24	0.42	a)
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	2'759	0	0	2'759 USD	91.89%	2'534'986.53	0.41	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	5'265	0	0	5'265 USD	87.34%	4'598'648.44	0.75	a)
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	2'451	0	0	2'451 USD	92.30%	2'262'196.53	0.37	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'517	0	0	2'517 USD	95.38%	2'400'588.75	0.39	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	2'365	0	2'365	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'147	220	0	2'367 USD	94.22%	2'230'157.81	0.36	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	2'481	0	0	2'481 USD	96.80%	2'401'530.59	0.39	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	2'413	0	2'413	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	2'290	0	0	2'290 USD	96.25%	2'204'125.00	0.36	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	3'170	0	0	3'170 USD	97.30%	3'084'311.10	0.50	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	5'163	0	0	5'163 USD	93.56%	4'830'631.88	0.79	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	2'318	0	2'318	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CE561	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	2'185	0	150	2'035 USD	95.66%	1'946'604.69	0.32	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	2'190	200	0	2'390 USD	96.91%	2'316'059.38	0.38	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	2'308	0	2'308	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	1'971	0	0	1'971 USD	97.75%	1'926'652.50	0.32	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	2'119	200	0	2'319 USD	98.53%	2'284'939.69	0.37	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	2'255	0	2'255	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	2'039	250	0	2'289 USD	97.09%	2'222'475.94	0.36	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	1'980	0	115	1'865 USD	94.97%	1'771'167.19	0.29	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	2'160	0	120	2'040 USD	98.78%	2'015'137.50	0.33	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	5'004	0	0	5'004 USD	92.47%	4'627'136.25	0.76	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	2'768	0	0	2'768 USD	98.11%	2'715'667.64	0.44	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	1'524	340	0	1'864 USD	97.16%	1'810'992.50	0.30	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	2'135	0	0	2'135 USD	99.11%	2'115'985.26	0.35	a)
US91282CFLO0	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	1'875	0	0	1'875 USD	100.53%	1'884'960.94	0.31	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	2'190	0	0	2'190 USD	101.00%	2'211'900.00	0.36	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	2'096	0	0	2'096 USD	99.92%	2'094'362.60	0.34	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	1'570	195	0	1'765 USD	101.09%	1'784'304.69	0.29	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	2'680	0	0	2'680 USD	100.97%	2'705'962.50	0.44	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	4'751	200	0	4'951 USD	101.88%	5'043'831.25	0.83	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	2'418	0	0	2'418 USD	100.27%	2'424'322.43	0.40	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	1'825	0	150	1'675 USD	100.53%	1'683'898.44	0.28	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	2'382	0	0	2'382 USD	100.25%	2'387'955.00	0.39	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	2'083	0	0	2'083 USD	99.72%	2'076'942.13	0.34	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	1'420	345	0	1'765 USD	100.50%	1'773'825.00	0.29	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	2'383	0	0	2'383 USD	100.33%	2'390'819.10	0.39	a)
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	2'081	0	0	2'081 USD	99.61%	2'072'871.20	0.34	a)
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	2'302	0	0	2'302 USD	99.09%	2'281'138.13	0.37	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	1'824	0	100	1'724 USD	98.66%	1'700'833.75	0.28	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	2'271	0	0	2'271 USD	99.83%	2'267'096.61	0.37	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	4'805	150	0	4'955 USD	97.28%	4'820'285.94	0.79	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	1'610	0	1'610	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	2'385	0	0	2'385 USD	100.73%	2'402'514.96	0.39	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	1'823	0	0	1'823 USD	101.13%	1'843'508.75	0.30	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	2'082	0	0	2'082 USD	100.78%	2'098'265.63	0.34	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	1'420	345	0	1'765 USD	99.22%	1'751'210.94	0.29	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	2'385	0	0	2'385 USD	99.55%	2'374'193.09	0.39	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	1'625	0	1'625	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	2'080	0	0	2'080 USD	99.52%	2'069'924.90	0.34	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 USD	in % 7)	Kat.
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	2'600	0	2'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	1'820	0	0	1'820 USD	98.59%	1'794'406.25	0.29	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	2'100	0	0	2'100 USD	99.09%	2'080'968.75	0.34	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	1'745	250	0	1'995 USD	99.33%	1'981'595.99	0.32	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	5'001	0	150	4'851 USD	96.22%	4'667'571.56	0.76	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	2'150	0	0	2'150 USD	99.50%	2'139'250.00	0.35	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	1'634	100	0	1'734 USD	99.84%	1'731'290.63	0.28	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	2'080	0	0	2'080 USD	100.22%	2'084'550.00	0.34	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	1'585	180	0	1'765 USD	99.80%	1'761'414.93	0.29	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	2'175	0	0	2'175 USD	100.84%	2'193'351.56	0.36	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	2'640	0	2'640	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	2'045	0	0	2'045 USD	100.92%	2'063'852.45	0.34	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	1'940	0	0	1'940 USD	101.31%	1'965'462.50	0.32	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	1'835	0	150	1'685 USD	101.11%	1'703'693.05	0.28	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	5'620	0	200	5'420 USD	99.80%	5'408'990.90	0.88	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	1'540	550	0	2'090 USD	100.80%	2'106'654.79	0.34	a)
US91282CHV63	5.0000 % T 5 08/31/25	2'800	0	615	2'185 USD	100.56%	2'197'290.63	0.36	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	1'885	0	0	1'885 USD	101.81%	1'919'165.63	0.31	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	2'670	0	0	2'670 USD	102.27%	2'730'492.05	0.45	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	1'790	400	0	2'190 USD	101.34%	2'219'428.13	0.36	a)
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	1'740	125	0	1'865 USD	104.47%	1'948'342.19	0.32	a)
US91282CIA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	2'800	0	350	2'450 USD	103.23%	2'529'242.31	0.41	a)
US91282CIB81	5.0000 % T 5 09/30/25	3'000	0	670	2'330 USD	100.67%	2'345'654.80	0.38	a)
US91282CIC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	2'395	0	0	2'395 USD	101.44%	2'429'428.13	0.40	a)
US91282CIE21	5.0000 % T 5 10/31/25	2'000	0	0	2'000 USD	100.77%	2'015'312.40	0.33	a)
US91282CIF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	2'200	0	0	2'200 USD	104.25%	2'293'500.00	0.38	a)
US91282CIG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	1'900	0	0	1'900 USD	105.91%	2'012'218.75	0.33	a)
US91282CIJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	5'275	470	0	5'745 USD	104.56%	6'007'115.63	0.98	a)
US91282CIK80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	1'600	800	0	2'400 USD	101.52%	2'436'374.88	0.40	a)
US91282CIL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	2'250	500	0	2'750 USD	100.73%	2'770'195.45	0.45	a)
US91282CIM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	1'900	100	0	2'000 USD	103.16%	2'063'125.00	0.34	a)
US91282CIN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	2'600	170	0	2'770 USD	102.41%	2'836'653.13	0.46	a)
US91282CIP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	1'500	1'000	0	2'500 USD	101.08%	2'526'953.00	0.41	a)
US91282CIQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	1'950	0	0	1'950 USD	99.72%	1'944'515.63	0.32	a)
US91282CIR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	2'700	220	0	2'920 USD	99.98%	2'919'543.90	0.48	a)
US91282CIS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	2'500	370	0	2'870 USD	100.05%	2'871'345.46	0.47	a)
US91282CIT99	4.0000 % T 4 01/15/27	2'000	600	0	2'600 USD	100.30%	2'607'718.88	0.43	a)
US91282CIV46	4.2500 % T 4 1/4 01/31/26	2'900	0	0	2'900 USD	100.13%	2'903'625.00	0.48	a)
US91282CJW29	4.0000 % T 4 01/31/29	2'850	225	0	3'075 USD	101.03%	3'106'710.94	0.51	a)
US91282CJX02	4.0000 % T 4 01/31/31	2'050	0	0	2'050 USD	101.11%	2'072'742.29	0.34	a)
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	2'050	3'930	0	5'980 USD	100.64%	6'018'309.08	0.98	a)
US91282CKA89	4.1250 % T 4 1/8 02/15/27	2'500	0	0	2'500 USD	100.61%	2'515'234.50	0.41	a)
US91282CKB62	4.6250 % T 4 5/8 02/28/26	0	3'175	0	3'175 USD	100.72%	3'197'820.31	0.52	a)
US91282CKC46	4.2500 % T 4 1/4 02/28/31	0	2'115	0	2'115 USD	102.55%	2'168'866.51	0.35	a)
US91282CKD29	4.2500 % T 4 1/4 02/28/29	0	3'225	0	3'225 USD	102.13%	3'293'531.25	0.54	a)
US91282CKE02	4.2500 % T 4 1/4 03/15/27	0	2'800	0	2'800 USD	101.02%	2'828'437.36	0.46	a)
US91282CKF76	4.1250 % T 4 1/8 03/31/31	0	2'150	0	2'150 USD	101.84%	2'189'640.63	0.36	a)
US91282CKG59	4.1250 % T 4 1/8 03/31/29	0	3'300	0	3'300 USD	101.58%	3'352'077.96	0.55	a)
US91282CKH33	4.5000 % T 4 1/2 03/31/26	0	3'300	0	3'300 USD	100.63%	3'320'625.00	0.54	a)
US91282CKJ98	4.5000 % T 4 1/2 04/15/27	0	2'900	0	2'900 USD	101.66%	2'948'031.25	0.48	a)
US91282CKK61	4.8750 % T 4 7/8 04/30/26	0	3'700	0	3'700 USD	101.30%	3'747'984.56	0.61	a)
US91282CKN01	4.6250 % T 4 5/8 04/30/31	0	2'150	0	2'150 USD	104.77%	2'252'460.83	0.37	a)
US91282CKP58	4.6250 % T 4 5/8 04/30/29	0	3'500	0	3'500 USD	103.73%	3'630'703.30	0.59	a)
US91282CKQ32	4.3750 % T 4 3/8 05/15/34	0	6'100	100	6'000 USD	103.64%	6'218'437.20	1.02	a)
US91282CKR15	4.5000 % T 4 1/2 05/15/27	0	2'900	0	2'900 USD	101.69%	2'948'937.50	0.48	a)
US91282CKS97	4.8750 % T 4 7/8 05/31/26	0	2'500	0	2'500 USD	101.41%	2'535'156.25	0.41	a)
US91282CKT70	4.5000 % T 4 1/2 05/31/29	0	3'500	0	3'500 USD	103.31%	3'615'937.50	0.59	a)
US91282CKU44	4.6250 % T 4 5/8 05/31/31	0	2'200	0	2'200 USD	104.78%	2'305'187.50	0.38	a)
US91282CKV27	4.6250 % T 4 5/8 06/15/27	0	2'900	0	2'900 USD	102.16%	2'962'531.25	0.48	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 USD	in % 7)	Kat.
US91282CKW00	4.2500 % T 4 1/4 06/30/31	0	2'200	0	2'200 USD	102.64%	2'258'093.64	0.37	a)
US91282CKX82	4.2500 % T 4 1/4 06/30/29	0	3'500	0	3'500 USD	102.22%	3'577'656.25	0.59	a)
US91282CKY65	4.6250 % T 4 5/8 06/30/26	0	1'000	0	1'000 USD	101.09%	1'010'937.50	0.17	a)
US91282CKZ31	4.3750 % T 4 3/8 07/15/27	0	2'900	0	2'900 USD	101.55%	2'944'859.52	0.48	a)
US91282CLB53	4.3750 % T 4 3/8 07/31/26	0	3'450	0	3'450 USD	100.75%	3'475'875.00	0.57	a)
US91282CLC37	4.0000 % T 4 07/31/29	0	3'500	0	3'500 USD	101.19%	3'541'562.50	0.58	a)
US91282CLD10	4.1250 % T 4 1/8 07/31/31	0	2'200	0	2'200 USD	101.89%	2'241'593.64	0.37	a)
US91282CLF67	3.8750 % T 3 7/8 08/15/34	0	2'100	0	2'100 USD	99.61%	2'091'796.88	0.34	a)
US91282CLG41	3.7500 % T 3 3/4 08/15/27	0	500	0	500 USD	99.88%	499'414.07	0.08	a)
USD							606'988'505.81	99.30	

Vermögensaufstellung	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	105'025.48	0.02
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	606'988'505.81	99.30
Sonstige Vermögenswerte	4'146'754.30	0.68
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	611'240'285.59	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'828'668.31	
Andere Verbindlichkeiten	-7'289.51	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	609'404'327.77	

Bewertungskategorien	Kurswert USD	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	606'988'505.81	99.30
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

Devisenkurse

CHF	1 = USD	1.17861984
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	-	-

5 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 USD	USD	0.00 - 0.08	-	0.042	-	-	-
GT USD	USD	0.00 - 0.08	-	0.042	-	-	-
NT USD	USD	0.00 - 0.08	-	0.042	-	-	-

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.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2024 - 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 USD	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
GT USD	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT USD	-	-	-	-	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.

8 Benchmark

FTSE US Government Bond Index TR

9 TER

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

10 Fussnoten

- 1) Der 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.
- 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: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

11 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.