

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND EMERGING MARKETS HARD CURRENCY

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
DTH1 CHF	39897025	CHF
GTH1 CHF	39897026	CHF
NT USD	120482891	USD
NTH1 CHF	39897027	CHF
STH1 CHF	39897028	CHF

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	25
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	25
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	25
7	Pauschale Verwaltungskommission	26
8	Benchmark	26
9	TER	26
10	Fussnoten	27
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	28

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		514'088'097.42	429'833'457.34	293'148'918.82	368'679'715.62
Klasse DTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)					84'320.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode					850.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)					91.0117
Thesaurierung je Anteil (in USD)					4.94
Total Expense Ratio (TER)					0.29 %
Klasse GTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		53'960'547.33	43'184'782.99	365'483.56	373'827.00
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		551'809.967	470'030.683	4'355.000	3'765.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.9685	80.9019	78.6566	91.0936
Thesaurierung je Anteil (in USD)		-	4.73	4.36	4.97
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.25 %	0.26 %	0.26 %
Klasse NT USD	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'447'675.45	20'323'873.57	18'448'974.35	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		220'105.456	184'586.374	182'240.878	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		115.6158	110.1050	101.2340	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		98.0943	96.9529	94.8816	
Thesaurierung je Anteil		-	5.84	3.12	
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		405'318'067.18	340'436'207.64	253'176'355.58	347'460'101.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'098'499.358	3'664'458.697	2'988'746.283	3'471'773.967
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.9068	81.8050	79.3943	91.8197
Thesaurierung je Anteil (in USD)		-	5.01	4.62	5.30
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse STH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		29'361'807.46	25'888'593.14	21'158'105.33	20'761'466.38
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		296.945	278.706	249.789	207.460
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83'894.4099	81'793.0030	79'388.7410	91'813.3969
Thesaurierung je Anteil (in USD)		-	5'016.67	4'621.66	5'303.41
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 DTH1 CHF (Schliessung 07.07.2022)	-	-	-20.74 %	-3.38 %
Klasse GTH1 CHF	4.42 %	5.57 %	-20.19 %	-3.35 %
Klasse NT USD (Lancierung 28.07.2022)	6.94 %	10.97 %	0.33 %	-
Klasse NTH1 CHF	4.52 %	5.86 %	-19.99 %	-3.10 %
Klasse STH1 CHF	4.52 %	5.85 %	-19.99 %	-3.10 %
Benchmark Hedge	4.45 %	6.13 %	-20.33 %	-
Benchmark	6.73 %	11.09 %	-17.78 %	-3.04 %
Tracking Error 33)	-	0.17 %	0.52 %	0.09 %

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 GTH1 CHF	-0.03 %
Klasse NT USD (Lancierung 28.07.2022)	0.21 %
Klasse NTH1 CHF	0.07 %
Klasse STH1 CHF	0.07 %

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	4'725'209.16	2'735'026.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	502'499'290.26	421'329'934.76
Sonstige Vermögenswerte	7'015'417.96	5'892'768.83
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'239'917.38	429'957'730.01
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-143'174.96	-116'040.97
Andere Verbindlichkeiten	-8'645.00	-8'231.70
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'088'097.42	429'833'457.34

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse GTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		470'030.683	4'355.000
Ausgegebene Anteile		126'339.889	471'803.225
Zurückgenommene Anteile		-44'560.605	-6'127.542
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		551'809.967	470'030.683
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		184'586.374	182'240.878
Ausgegebene Anteile		35'680.082	41'716.496
Zurückgenommene Anteile		-161.000	-39'371.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		220'105.456	184'586.374
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'664'458.697	2'988'746.283
Ausgegebene Anteile		658'942.603	1'130'608.678
Zurückgenommene Anteile		-224'901.942	-454'896.264
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'098'499.358	3'664'458.697
Klasse STH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		278.706	249.789
Ausgegebene Anteile		20.907	30.875
Zurückgenommene Anteile		-2.668	-1.958
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		296.945	278.706

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		429'833'457.34	293'148'918.82
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-8'327'987.88	-6'330'299.21
Saldo aus dem Anteilverkehr		51'264'542.49	103'821'031.27
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		41'318'085.47	39'193'806.46
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		514'088'097.42	429'833'457.34

Erfolgsrechnung

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		86'824.28	127'186.71
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		12'462'586.22	20'657'917.98
Sonstige Erträge		180'542.88	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'119'063.71	3'800'369.83
Total Ertrag		13'849'017.09	24'585'474.52
Aufwand			
Passivzinsen		-36.73	-13.59
Reglementarische Vergütungen		-45'510.40	-16'910.99
Sonstige Aufwendungen		-61.13	-89.74
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-186'220.55	-1'477'320.77
Total Aufwand		-231'828.81	-1'494'335.09
Nettoertrag / Verlust		13'617'188.28	23'091'139.43
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		7'249'445.84	-5'423'204.90
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		448'595.07	804'768.88
Realisierter Erfolg		21'315'229.19	18'472'703.41
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		20'002'856.28	20'721'103.05
Gesamterfolg		41'318'085.47	39'193'806.46

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							498'695'777.20	96.98	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							498'695'777.20	96.98	
US040114HS26	0.7500 % ARGENT 0 3/4 07/09/30	4'355	950	290	5'015 USD	56.85%	2'736'964.02	0.53	a)
US040114HT09	4.1250 % ARGENT 4 1/8 07/09/35	5'627	900	300	6'227 USD	44.35%	2'761'601.77	0.54	a)
US040114HU71	5.0000 % ARGENT 5 01/09/38	3'270	450	420	3'300 USD	48.65%	1'605'450.00	0.31	a)
US040114HV54	3.5000 % ARGENT 3 1/2 07/09/41	2'900	600	200	3'300 USD	41.65%	1'374'450.00	0.27	a)
US040114HW38	4.1250 % ARGENT 4 1/8 07/09/46	520	150	0	670 USD	46.55%	311'885.00	0.06	a)
US040114HX11	1.0000 % ARGENT 1 07/09/29	674	200	0	874 USD	60.15%	525'668.29	0.10	a)
US05968AAG13	2.7040 % BANCO 2.704 01/09/25 REGS	200	0	0	200 USD	98.80%	197'592.00	0.04	a)
US105756AE07	10.1250 % BRAZIL 10 1/8 05/15/27	420	0	200	220 USD	112.96%	248'509.80	0.05	a)
US105756BB58	8.2500 % BRAZIL 8 1/4 01/20/34	500	0	0	500 USD	115.89%	579'450.00	0.11	a)
US105756BF62	8.7500 % BRAZIL 8 3/4 02/04/25	350	0	150	200 USD	101.37%	202'746.00	0.04	a)
US105756BK57	7.1250 % BRAZIL 7 1/8 01/20/37	750	0	0	750 USD	108.61%	814'597.50	0.16	a)
US105756BR01	5.6250 % BRAZIL 5 5/8 01/07/41	800	0	0	800 USD	92.17%	737'368.00	0.14	a)
US105756BV13	4.2500 % BRAZIL 4 1/4 01/07/25	1'600	0	200	1'400 USD	99.49%	1'392'874.00	0.27	a)
US105756BW95	5.0000 % BRAZIL 5 01/27/45	1'200	200	0	1'400 USD	80.80%	1'131'200.00	0.22	a)
US105756BX78	6.0000 % BRAZIL 6 04/07/26	800	0	0	800 USD	101.69%	813'552.00	0.16	a)
US105756BY51	5.6250 % BRAZIL 5 5/8 02/21/47	1'020	0	0	1'020 USD	86.91%	886'492.20	0.17	a)
US105756BZ27	4.6250 % BRAZIL 4 5/8 01/13/28	1'200	0	200	1'000 USD	99.63%	996'260.00	0.19	a)
US105756CA66	4.5000 % BRAZIL 4 1/2 05/30/29	800	0	200	600 USD	97.30%	583'788.00	0.11	a)
US105756CB40	4.7500 % BRAZIL 4 3/4 01/14/50	1'650	0	0	1'650 USD	75.96%	1'253'307.00	0.24	a)
US105756CC23	3.8750 % BRAZIL 3 7/8 06/12/30	1'450	0	200	1'250 USD	91.75%	1'146'875.00	0.22	a)
US105756CD06	2.8750 % BRAZIL 2 7/8 06/06/25	600	0	0	600 USD	98.11%	588'636.00	0.11	a)
US105756CE88	3.7500 % BRAZIL 3 3/4 09/12/31	600	0	0	600 USD	88.89%	533'364.00	0.10	a)
US105756CF53	6.0000 % BRAZIL 6 10/20/33	900	0	0	900 USD	100.13%	901'170.00	0.18	a)
US105756CG37	6.2500 % BRAZIL 6 1/4 03/18/31	660	0	0	660 USD	103.27%	681'562.20	0.13	a)
US105756CH10	6.1250 % BRAZIL 6 1/8 03/15/34	0	950	0	950 USD	101.14%	960'801.50	0.19	a)
US105756CJ75	7.1250 % BRAZIL 7 1/8 05/13/54	0	1'050	0	1'050 USD	102.40%	1'075'221.00	0.21	a)
US105756CK49	6.1250 % BRAZIL 6 1/8 01/22/32	0	900	0	900 USD	101.62%	914'562.00	0.18	a)
US168863CA49	3.1250 % CHILE 3 1/8 01/21/26	200	0	0	200 USD	97.78%	195'562.00	0.04	a)
US168863CE60	3.8600 % CHILE 3.86 06/21/47	400	200	200	400 USD	81.41%	325'624.00	0.06	a)
US168863CF36	3.2400 % CHILE 3.24 02/06/28	600	200	200	600 USD	95.94%	575'628.00	0.11	a)
US168863DL94	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/25/50	750	0	0	750 USD	75.50%	566'250.00	0.11	a)
US168863DN50	2.5500 % CHILE 2.55 01/27/32	400	0	0	400 USD	87.20%	348'800.00	0.07	a)
US168863DP09	2.4500 % CHILE 2.45 01/31/31	400	200	0	600 USD	88.50%	531'000.00	0.10	a)
US168863DQ81	3.1000 % CHILE 3.1 01/22/61	550	200	0	750 USD	65.65%	492'375.00	0.10	a)
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	800	200	0	1'000 USD	76.84%	768'440.00	0.15	a)
US168863DT21	2.5500 % CHILE 2.55 07/27/33	600	200	0	800 USD	84.59%	676'752.00	0.13	a)
US168863DU93	3.2500 % CHILE 3 1/4 09/21/2071	400	200	200	400 USD	65.80%	263'200.00	0.05	a)
US168863DV76	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/31/34	600	0	200	400 USD	90.69%	362'750.00	0.07	a)
US168863DW59	4.0000 % CHILE 4 01/31/52	400	200	200	400 USD	81.47%	325'876.00	0.06	a)
US168863DX33	2.7500 % CHILE 2 3/4 01/31/27	450	0	0	450 USD	95.84%	431'298.00	0.08	a)
US168863DY16	4.3400 % CHILE 4.34 03/07/42	600	0	0	600 USD	90.05%	540'300.00	0.11	a)
US168863DZ80	4.9500 % CHILE 4.95 01/05/36	600	200	200	600 USD	100.00%	600'000.00	0.12	a)
US168863EA21	5.3300 % CHILE 5.33 01/05/54	533	0	0	533 USD	99.19%	528'289.17	0.10	a)
US168863EB04	4.8500 % CHILE 4.85 01/22/29	550	0	0	550 USD	101.53%	558'420.50	0.11	a)
US195325BK01	7.3750 % COLOM 7 3/8 09/18/37	800	200	150	850 USD	100.65%	855'525.00	0.17	a)
US195325BM66	6.1250 % COLOM 6 1/8 01/18/41	1'050	0	0	1'050 USD	87.15%	915'075.00	0.18	a)
US195325BR53	5.6250 % COLOM 5 5/8 02/26/44	1'000	200	0	1'200 USD	79.65%	955'740.00	0.19	a)
US195325CU73	5.0000 % COLOM 5 06/15/45	1'800	300	0	2'100 USD	72.50%	1'522'395.00	0.30	a)
US195325CX13	4.5000 % COLOM 4 1/2 01/28/26	600	0	0	600 USD	98.45%	590'700.00	0.11	a)
US195325DL65	3.8750 % COLOM 3 7/8 04/25/27	800	200	200	800 USD	95.75%	766'000.00	0.15	a)
US195325DP79	4.5000 % COLOM 4 1/2 03/15/29	800	0	0	800 USD	93.75%	750'000.00	0.15	a)
US195325DQ52	5.2000 % COLOM 5.2 05/15/49	1'200	200	200	1'200 USD	73.40%	880'740.00	0.17	a)
US195325DR36	3.0000 % COLOM 3 01/30/30	800	200	200	800 USD	84.65%	677'200.00	0.13	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.
US195325DS19	3.1250 % COLOM 3 1/8 04/15/31	1'000	200	0	1'200 USD	81.75%	981'000.00	0.19	a)
US195325DT91	4.1250 % COLOM 4 1/8 05/15/51	670	0	0	670 USD	62.60%	419'386.50	0.08	a)
US195325DX04	3.8750 % COLOM 3 7/8 02/15/61	500	200	0	700 USD	57.70%	403'865.00	0.08	a)
US195325DZ51	3.2500 % COLOM 3 1/4 04/22/32	800	0	0	800 USD	79.70%	637'600.00	0.12	a)
US195325EA91	4.1250 % COLOM 4 1/8 02/22/42	450	0	0	450 USD	68.56%	308'497.50	0.06	a)
US195325EF88	8.0000 % COLOM 8 04/20/33	600	200	0	800 USD	106.55%	852'400.00	0.17	a)
US195325EG61	7.5000 % COLOM 7 1/2 02/02/34	950	0	0	950 USD	103.10%	979'450.00	0.19	a)
US195325EL56	8.0000 % COLOM 8 11/14/35	450	500	0	950 USD	106.10%	1'007'950.00	0.20	a)
US195325EM30	8.7500 % COLOM 8 3/4 11/14/53	450	400	0	850 USD	108.80%	924'757.50	0.18	a)
US445545AF36	7.6250 % REPHUN 7 5/8 03/29/41 30Y	1'050	440	250	1'240 USD	118.13%	1'464'750.00	0.28	a)
US455780CD62	3.5000 % INDON 3 1/2 01/11/28	200	0	0	200 USD	97.28%	194'562.50	0.04	a)
US455780CE46	4.3500 % INDON 4.35 01/11/48	400	0	0	400 USD	90.47%	361'875.00	0.07	a)
US455780CF11	4.1000 % INDON 4.1 04/24/28	200	0	0	200 USD	99.16%	198'312.50	0.04	a)
US455780CH76	4.7500 % INDON 4 3/4 02/11/29	200	0	0	200 USD	101.44%	202'875.00	0.04	a)
US455780CJ33	5.3500 % INDON 5.35 02/11/49	200	0	0	200 USD	103.75%	207'500.00	0.04	a)
US455780CK06	3.4000 % INDON 3.4 09/18/29	200	0	0	200 USD	95.16%	190'312.50	0.04	a)
US455780CN45	3.7000 % INDON 3.7 10/30/49	200	0	0	200 USD	80.72%	161'437.50	0.03	a)
US455780CQ75	2.8500 % INDON 2.85 02/14/30	400	0	200	200 USD	91.88%	183'750.00	0.04	a)
US455780CR58	3.5000 % INDON 3 1/2 02/14/50	200	200	200	200 USD	78.06%	156'125.00	0.03	a)
US455780CS32	3.8500 % INDON 3.85 10/15/30	300	0	0	300 USD	96.25%	288'750.00	0.06	a)
US455780CT15	4.2000 % INDON 4.2 10/15/50	400	0	0	400 USD	87.66%	350'625.00	0.07	a)
US455780CU87	4.4500 % INDON 4.45 04/15/70	200	0	0	200 USD	87.47%	174'937.50	0.03	a)
US455780CV60	1.8500 % INDON 1.85 03/12/31	200	200	200	200 USD	84.91%	169'812.50	0.03	a)
US455780CW44	3.0500 % INDON 3.05 03/12/51	400	200	0	600 USD	71.44%	428'625.00	0.08	a)
US455780CX27	3.3500 % INDON 3.35 03/12/2071	200	0	0	200 USD	69.88%	139'750.00	0.03	a)
US455780CY00	2.1500 % INDON 2.15 07/28/31	200	0	0	200 USD	85.50%	171'000.00	0.03	a)
US455780DG84	3.2000 % INDON 3.2 09/23/61	200	0	0	200 USD	68.47%	136'937.50	0.03	a)
US455780DJ24	3.5500 % INDON 3.55 03/31/32	200	0	0	200 USD	93.31%	186'625.00	0.04	a)
US455780DK96	4.3000 % INDON 4.3 03/31/52	200	0	0	200 USD	88.69%	177'375.00	0.03	a)
US455780DM52	4.1500 % INDON 4.15 09/20/27	200	0	0	200 USD	99.41%	198'812.50	0.04	a)
US455780DN36	4.6500 % INDON 4.65 09/20/32	200	200	0	400 USD	100.00%	400'000.00	0.08	a)
US455780DP83	5.4500 % INDON 5.45 09/20/52	0	200	0	200 USD	104.28%	208'562.50	0.04	a)
US455780DQ66	4.5500 % INDON 4.55 01/11/28	200	0	0	200 USD	100.28%	200'562.50	0.04	a)
US455780DR40	4.8500 % INDON 4.85 01/11/33	300	0	0	300 USD	101.13%	303'375.00	0.06	a)
US455780DS23	5.6500 % INDON 5.65 01/11/53	200	0	0	200 USD	106.81%	213'625.00	0.04	a)
US455780DT06	4.4000 % INDON 4.4 03/10/29	200	0	0	200 USD	99.97%	199'937.50	0.04	a)
US455780DU78	4.7000 % INDON 4.7 02/10/34	200	0	0	200 USD	99.78%	199'562.50	0.04	a)
US455780DV51	5.1000 % INDON 5.1 02/10/54	200	0	0	200 USD	99.78%	199'562.50	0.04	a)
US470160AV46	8.0000 % JAMAN 8 03/15/39	850	250	150	950 USD	121.25%	1'151'875.00	0.22	a)
US470160CA80	6.7500 % JAMAN 6 3/4 04/28/28	800	0	0	800 USD	105.14%	841'128.00	0.16	a)
US470160CB63	7.8750 % JAMAN 7 7/8 07/28/45	1'200	0	0	1'200 USD	120.91%	1'450'872.00	0.28	a)
US67778NAA63	7.5000 % OILGAS 7 1/2 10/25/27 REGS	600	0	0	600 USD	104.03%	624'187.50	0.12	a)
US69370RAA59	6.4500 % PERTIJ 6.45 05/30/44 REGS	200	0	0	200 USD	109.16%	218'320.00	0.04	a)
US69370RAC16	6.5000 % PERTIJ 6 1/2 11/07/48 REGS	200	0	0	200 USD	111.47%	222'938.00	0.04	a)
US69370RAD98	3.6500 % PERTIJ 3.65 07/30/29 REGS	200	0	0	200 USD	95.31%	190'625.00	0.04	a)
US69370RAE71	4.7000 % PERTIJ 4.7 07/30/49 REGS	200	0	0	200 USD	88.69%	177'376.00	0.03	a)
US69370RAF47	3.1000 % PERTIJ 3.1 01/21/30 REGS	0	400	200	200 USD	91.88%	183'750.00	0.04	a)
US69370RAG20	4.1750 % PERTIJ 4.175 01/21/50 REGS	200	0	0	200 USD	81.78%	163'550.00	0.03	a)
US69370RAH03	3.1000 % PERTIJ 3.1 08/27/30 REGS	200	0	0	200 USD	91.07%	182'142.00	0.04	a)
US69370RAJ68	4.1500 % PERTIJ 4.15 02/25/60 REGS	200	0	0	200 USD	78.30%	156'600.00	0.03	a)
US69370RAK32	1.4000 % PERTIJ 1.4 02/09/26 REGS	200	0	0	200 USD	95.25%	190'500.00	0.04	a)
US69370RAL15	2.3000 % PERTIJ 2.3 02/09/31 REGS	200	0	0	200 USD	86.01%	172'016.00	0.03	a)
US698299AD63	8.8750 % PANAMA 8 7/8 09/30/27	350	0	0	350 USD	109.84%	384'454.00	0.07	a)
US698299AK07	9.3750 % PANAMA 9 3/8 04/01/29	400	100	0	500 USD	113.90%	569'500.00	0.11	a)
US698299AV61	7.1250 % PANAMA 7 1/8 01/29/26	400	0	0	400 USD	102.40%	409'600.00	0.08	a)
US698299AW45	6.7000 % PANAMA 6.7 01/26/36	900	0	0	900 USD	101.81%	916'312.50	0.18	a)
US698299BB98	4.3000 % PANAMA 4.3 04/29/53	800	200	200	800 USD	68.34%	546'752.00	0.11	a)
US698299BE38	3.7500 % PANAMA 3 3/4 03/16/25	600	0	0	600 USD	98.85%	593'094.00	0.12	a)
US698299BF03	3.8750 % PANAMA 3 7/8 03/17/28	600	0	0	600 USD	94.50%	567'000.00	0.11	a)
US698299BG85	4.5000 % PANAMA 4 1/2 05/15/47	600	0	0	600 USD	72.99%	437'958.00	0.09	a)
US698299BH68	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/16/50	1'000	200	0	1'200 USD	71.06%	852'720.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US698299BK97	3.1600 % PANAMA 3.16 01/23/30	600	0	0	600 USD	86.80%	520'800.00	0.10	a)
US698299BL70	3.8700 % PANAMA 3.87 07/23/60	1'300	0	0	1'300 USD	61.03%	793'403.00	0.15	a)
US698299BM53	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/01/56	1'000	0	0	1'000 USD	69.72%	697'190.00	0.14	a)
US698299BN37	2.2520 % PANAMA 2.252 09/29/32	1'200	0	0	1'200 USD	74.85%	898'200.00	0.17	a)
US698299BR41	3.2980 % PANAMA 3.298 01/19/33	400	0	0	400 USD	81.12%	324'460.00	0.06	a)
US698299BS24	4.5000 % PANAMA 4 1/2 01/19/63	600	200	0	800 USD	67.94%	543'504.00	0.11	a)
US698299BT07	6.4000 % PANAMA 6.4 02/14/35	1'050	0	0	1'050 USD	99.77%	1'047'532.50	0.20	a)
US698299BV52	6.8530 % PANAMA 6.853 03/28/54	700	700	700	700 USD	98.03%	686'217.00	0.13	a)
US698299BW36	6.8750 % PANAMA 6 7/8 01/31/36	400	0	0	400 USD	102.50%	410'000.00	0.08	a)
US698299BX19	7.5000 % PANAMA 7 1/2 03/01/31	0	500	0	500 USD	107.00%	535'000.00	0.10	a)
US698299BY91	8.0000 % PANAMA 8 03/01/38	0	500	0	500 USD	110.22%	551'095.00	0.11	a)
US698299BZ66	7.8750 % PANAMA 7 7/8 03/01/57	0	450	0	450 USD	109.56%	493'033.50	0.10	a)
US706451BG56	6.6250 % PEMEX 6 5/8 06/15/35	500	100	0	600 USD	77.70%	466'200.00	0.09	a)
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	1'100	150	0	1'250 USD	125.25%	1'565'625.00	0.30	a)
US715638AS19	7.3500 % PERU 7.35 07/21/25	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US715638AU64	6.5500 % PERU 6.55 03/14/37	600	50	0	650 USD	111.25%	723'125.00	0.14	a)
US715638BM30	5.6250 % PERU 5 5/8 11/18/50	1'390	360	250	1'500 USD	101.80%	1'527'000.00	0.30	a)
US715638BU55	4.1250 % PERU 4 1/8 08/25/27	400	400	400	400 USD	98.65%	394'616.00	0.08	a)
US715638DA73	2.8440 % PERU 2.844 06/20/30	400	0	0	400 USD	90.40%	361'600.00	0.07	a)
US715638DE95	2.3920 % PERU 2.392 01/23/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	1'770	250	150	1'870 USD	88.41%	1'653'313.75	0.32	a)
US715638DP43	1.8620 % PERU 1.862 12/01/32	500	0	0	500 USD	79.41%	397'062.50	0.08	a)
US715638DQ26	2.7800 % PERU 2.78 12/01/60	1'100	200	100	1'200 USD	59.34%	712'125.00	0.14	a)
US715638DR09	3.2300 % PERU 3.23 07/28/2121	450	100	0	550 USD	58.78%	323'296.88	0.06	a)
US715638DS81	3.3000 % PERU 3.3 03/11/41	580	130	0	710 USD	78.13%	554'687.50	0.11	a)
US715638DT64	3.5500 % PERU 3.55 03/10/51	870	100	0	970 USD	74.72%	724'771.88	0.14	a)
US715638DU38	3.0000 % PERU 3 01/15/34	1'260	200	160	1'300 USD	84.88%	1'103'375.00	0.21	a)
US715638DW93	3.6000 % PERU 3.6 01/15/2072	500	100	0	600 USD	67.38%	404'250.00	0.08	a)
US715638EB48	5.3750 % PERU 5 3/8 02/08/35	0	500	0	500 USD	101.60%	508'000.00	0.10	a)
US715638EC21	5.8750 % PERU 5 7/8 08/08/54	0	900	0	900 USD	104.25%	938'250.00	0.18	a)
US71567RAD89	4.3250 % INDOIS 4.325 05/28/25 REGS	400	0	0	400 USD	99.96%	399'836.00	0.08	a)
US71567RAF38	4.5500 % INDOIS 4.55 03/29/26 REGS	400	0	0	400 USD	100.31%	401'250.00	0.08	a)
US71567RAH93	4.1500 % INDOIS 4.15 03/29/27 REGS	400	0	0	400 USD	99.78%	399'125.00	0.08	a)
US71567RAK23	4.4000 % INDOIS 4.4 03/01/28 REGS	400	0	0	400 USD	100.31%	401'250.00	0.08	a)
US71567RAM88	4.4500 % INDOIS 4.45 02/20/29 REGS	200	200	0	400 USD	100.25%	401'000.00	0.08	a)
US71567RAN61	2.3000 % INDOIS 2.3 06/23/25 REGS	200	0	0	200 USD	98.40%	196'792.00	0.04	a)
US71567RAP10	2.8000 % INDOIS 2.8 06/23/30 REGS	200	0	0	200 USD	91.38%	182'750.00	0.04	a)
US71567RAQ92	3.8000 % INDOIS 3.8 06/23/50 REGS	200	0	0	200 USD	81.28%	162'562.00	0.03	a)
US71567RAR75	1.5000 % INDOIS 1 1/2 06/09/26 REGS	200	200	0	400 USD	95.03%	380'125.00	0.07	a)
US71567RAS58	2.5500 % INDOIS 2.55 06/09/31 REGS	200	0	0	200 USD	88.31%	176'625.00	0.03	a)
US71567RAT32	3.5500 % INDOIS 3.55 06/09/51 REGS	200	0	0	200 USD	77.47%	154'938.00	0.03	a)
US71567RAU05	4.4000 % INDOIS 4.4 06/06/27 REGS	400	0	0	400 USD	100.41%	401'625.00	0.08	a)
US71567RAV87	4.7000 % INDOIS 4.7 06/06/32 REGS	400	200	200	400 USD	100.78%	403'125.00	0.08	a)
US71567RAX44	5.4000 % INDOIS 5.4 11/15/28 REGS	200	200	0	400 USD	103.97%	415'875.00	0.08	a)
US71567RAY27	5.6000 % INDOIS 5.6 11/15/33 REGS	200	0	0	200 USD	106.69%	213'375.00	0.04	a)
US71568QAB32	5.2500 % PLNIJ 5 1/4 10/24/42 REGS	200	0	0	200 USD	93.69%	187'376.00	0.04	a)
US71568QAC15	4.1250 % PLNIJ 4 1/8 05/15/27 REGS	400	0	0	400 USD	98.13%	392'500.00	0.08	a)
US71568QAE70	5.4500 % PLNIJ 5.45 05/21/28 REGS	200	0	0	200 USD	101.72%	203'448.00	0.04	a)
US71568QAF46	6.1500 % PLNIJ 6.15 05/21/48 REGS	200	0	0	200 USD	102.34%	204'688.00	0.04	a)
US71568QAH02	6.2500 % PLNIJ 6 1/4 01/25/49 REGS	200	200	200	200 USD	103.47%	206'938.00	0.04	a)
US71568QAJ67	3.8750 % PLNIJ 3 7/8 07/17/29 REGS	200	0	0	200 USD	95.69%	191'375.00	0.04	a)
US71568QAK31	4.8750 % PLNIJ 4 7/8 07/17/49 REGS	200	0	0	200 USD	86.18%	172'360.00	0.03	a)
US71568QAL14	3.3750 % PLNIJ 3 3/8 02/05/30 REGS	200	0	0	200 USD	92.31%	184'620.00	0.04	a)
US71568QAM96	4.3750 % PLNIJ 4 3/8 02/05/50 REGS	200	0	0	200 USD	80.53%	161'062.00	0.03	a)
US71568QAN79	3.0000 % PLNIJ 3 06/30/30 REGS	0	200	0	200 USD	90.09%	180'188.00	0.04	a)
US71568QAP28	4.0000 % PLNIJ 4 06/30/50 REGS	200	0	0	200 USD	75.55%	151'098.00	0.03	a)
US71643VAB18	6.7000 % PEMEX 6.7 02/16/32	1'153	415	100	1'468 USD	85.85%	1'260'278.00	0.25	a)
US71654QAZ54	6.5000 % PEMEX 6 1/2 06/02/41	300	100	100	300 USD	70.38%	211'125.00	0.04	a)
US71654QBE17	5.5000 % PEMEX 5 1/2 06/27/44	100	0	0	100 USD	62.75%	62'750.00	0.01	a)
US71654QBR20	6.3750 % PEMEX 6 3/8 01/23/45	200	100	0	300 USD	67.28%	201'843.75	0.04	a)
US71654QBV32	4.2500 % PEMEX 4 1/4 01/15/25	100	0	0	100 USD	99.13%	99'125.00	0.02	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.
US71654QBW15	4.5000 % PEMEX 4 1/2 01/23/26	200	0	0	200 USD	96.16%	192'312.50	0.04	a)
US71654QBX97	5.6250 % PEMEX 5 5/8 01/23/46	160	0	0	160 USD	61.83%	98'928.00	0.02	a)
US71654QCB68	6.8750 % PEMEX 6 7/8 08/04/26	400	100	0	500 USD	98.56%	492'815.00	0.10	a)
US71654QCC42	6.7500 % PEMEX 6 3/4 09/21/47	1'040	300	250	1'090 USD	68.04%	741'625.10	0.14	a)
US71654QCG55	6.5000 % PEMEX 6 1/2 03/13/27	690	125	0	815 USD	96.18%	783'826.25	0.15	a)
US71654QCK67	5.3500 % PEMEX 5.35 02/12/28	350	100	0	450 USD	91.17%	410'260.50	0.08	a)
US71654QCL41	6.3500 % PEMEX 6.35 02/12/48	360	0	0	360 USD	66.01%	237'643.20	0.05	a)
US71654QCP54	6.5000 % PEMEX 6 1/2 01/23/29	280	60	100	240 USD	91.78%	220'275.00	0.04	a)
US71654QDB59	6.4900 % PEMEX 6.49 01/23/27	300	0	0	300 USD	97.02%	291'057.00	0.06	a)
US71654QDC33	6.8400 % PEMEX 6.84 01/23/30	519	120	100	539 USD	90.04%	485'315.60	0.09	a)
US71654QDD16	7.6900 % PEMEX 7.69 01/23/50	1'431	500	220	1'711 USD	74.22%	1'269'904.20	0.25	a)
US71654QDE98	5.9500 % PEMEX 5.95 01/28/31	702	100	80	722 USD	82.72%	597'231.18	0.12	a)
US71654QDF63	6.9500 % PEMEX 6.95 01/28/60	705	120	0	825 USD	68.11%	561'932.25	0.11	a)
US71654QDH20	6.8750 % PEMEX 6 7/8 10/16/25	200	0	100	100 USD	99.91%	99'906.25	0.02	a)
US71654QDL32	8.7500 % PEMEX 8 3/4 06/02/29	300	125	0	425 USD	99.15%	421'387.50	0.08	a)
US71654QDP46	10.0000 % PEMEX 10 02/07/33	330	100	0	430 USD	102.25%	439'675.00	0.09	a)
US71656MAF68	6.6250 % PEMEX 6 5/8 PERP REGS	130	0	0	130 USD	63.00%	81'900.00	0.02	a)
US718286AP29	10.6250 % PHILIP 10 5/8 03/16/25	650	0	100	550 USD	103.04%	566'725.50	0.11	a)
US718286AY36	9.5000 % PHILIP 9 1/2 02/02/30	700	600	350	950 USD	123.44%	1'172'656.25	0.23	a)
US718286BB24	7.7500 % PHILIP 7 3/4 01/14/31	600	100	0	700 USD	117.06%	819'437.50	0.16	a)
US718286BD89	6.3750 % PHILIP 6 3/8 01/15/32	400	150	100	450 USD	110.25%	496'125.00	0.10	a)
US718286BG11	6.3750 % PHILIP 6 3/8 10/23/34	750	100	0	850 USD	112.69%	957'843.75	0.19	a)
US718286BN61	5.5000 % PHILIP 5 1/2 03/30/26	400	0	0	400 USD	101.47%	405'875.00	0.08	a)
US718286BW60	5.0000 % PHILIP 5 01/13/37	600	200	200	600 USD	101.91%	611'437.50	0.12	a)
US718286BZ91	3.9500 % PHILIP 3.95 01/20/40	800	0	0	800 USD	88.84%	710'750.00	0.14	a)
US718286CA32	3.7000 % PHILIP 3.7 03/01/41	800	0	0	800 USD	84.97%	679'750.00	0.13	a)
US718286CB15	3.7000 % PHILIP 3.7 02/02/42	600	200	0	800 USD	84.69%	677'500.00	0.13	a)
US718286CC97	3.0000 % PHILIP 3 02/01/28	800	0	0	800 USD	95.56%	764'500.00	0.15	a)
US718286CG02	3.7500 % PHILIP 3 3/4 01/14/29	600	0	0	600 USD	97.46%	584'766.00	0.11	a)
US718286CH84	2.9500 % PHILIP 2.95 05/05/45	650	200	200	650 USD	72.41%	470'640.63	0.09	a)
US718286CJ41	2.4570 % PHILIP 2.457 05/05/30	400	0	0	400 USD	89.72%	358'875.00	0.07	a)
US718286CK14	1.6480 % PHILIP 1.648 06/10/31	400	0	0	400 USD	83.06%	332'250.00	0.06	a)
US718286CL96	2.6500 % PHILIP 2.65 12/10/45	570	0	0	570 USD	68.56%	390'806.25	0.08	a)
US718286CN52	1.9500 % PHILIP 1.95 01/06/32	400	0	0	400 USD	83.34%	333'375.00	0.06	a)
US718286CP01	3.2000 % PHILIP 3.2 07/06/46	850	300	0	1'150 USD	74.38%	855'312.50	0.17	a)
US718286CQ83	3.2290 % PHILIP 3.229 03/29/27	200	0	0	200 USD	97.19%	194'375.00	0.04	a)
US718286CR66	3.5560 % PHILIP 3.556 09/29/32	400	0	0	400 USD	92.56%	370'250.00	0.07	a)
US718286CT23	5.6090 % PHILIP 5.609 04/13/33	200	200	0	400 USD	105.94%	423'750.00	0.08	a)
US718286CU95	5.9500 % PHILIP 5.95 10/13/47	250	200	0	450 USD	110.44%	496'968.75	0.10	a)
US718286CV78	5.1700 % PHILIP 5.17 10/13/27	200	0	0	200 USD	102.13%	204'250.00	0.04	a)
US718286CW51	5.0000 % PHILIP 5 07/17/33	470	0	0	470 USD	101.91%	478'959.38	0.09	a)
US718286CX35	5.5000 % PHILIP 5 1/2 01/17/48	620	0	200	420 USD	104.50%	438'900.00	0.09	a)
US718286CY18	4.6250 % PHILIP 4 5/8 07/17/28	200	0	0	200 USD	100.81%	201'625.00	0.04	a)
US718286DA23	5.2500 % PHILIP 5 1/4 05/14/34	0	450	0	450 USD	103.81%	467'156.25	0.09	a)
US718286DB06	5.6000 % PHILIP 5.6 05/14/49	0	450	0	450 USD	105.69%	475'593.75	0.09	a)
US731011AU68	3.2500 % POLAND 3 1/4 04/06/26	1'150	80	60	1'170 USD	98.43%	1'151'642.70	0.22	a)
US731011AV42	4.8750 % POLAND 4 7/8 10/04/33	1'630	0	0	1'630 USD	101.06%	1'647'278.00	0.32	a)
US731011AW25	5.5000 % POLAND 5 1/2 04/04/53	1'670	0	60	1'610 USD	102.15%	1'644'550.60	0.32	a)
US731011AX08	4.6250 % POLAND 4 5/8 03/18/29	0	950	0	950 USD	101.92%	968'259.00	0.19	a)
US731011AY80	5.1250 % POLAND 5 1/8 09/18/34	0	1'950	0	1'950 USD	102.57%	2'000'095.50	0.39	a)
US731011AZ55	5.5000 % POLAND 5 1/2 03/18/54	0	2'320	0	2'320 USD	102.33%	2'374'102.40	0.46	a)
US760942AS16	7.6250 % URUGUA 7 5/8 03/21/36	730	100	130	700 USD	123.88%	867'125.00	0.17	a)
US760942AY83	4.1250 % URUGUA 4 1/8 11/20/45	490	0	0	490 USD	91.13%	446'512.50	0.09	a)
US760942BA98	5.1000 % URUGUA 5 1 06/18/50	2'530	320	100	2'750 USD	99.25%	2'729'375.00	0.53	a)
US760942BB71	4.3750 % URUGUA 4 3/8 10/27/27	930	120	120	930 USD	100.64%	935'933.40	0.18	a)
US760942BD38	4.9750 % URUGUA 4.975 04/20/55	1'700	300	120	1'880 USD	96.28%	1'810'082.80	0.35	a)
US760942BE11	5.7500 % URUGUA 5 3/4 10/28/34	1'500	150	100	1'550 USD	108.31%	1'678'843.75	0.33	a)
US77586TAE64	6.1250 % ROMANI 6 1/8 01/22/44 REGS	680	0	0	680 USD	99.00%	673'200.00	0.13	a)
US836205AP92	6.2500 % SOAF 6 1/4 03/08/41	400	0	0	400 USD	90.93%	363'712.00	0.07	a)
US836205AR58	5.8750 % SOAF 5 7/8 09/16/25	1'000	400	200	1'200 USD	100.26%	1'203'150.00	0.23	a)
US836205AS32	5.3750 % SOAF 5 3/8 07/24/44	600	0	0	600 USD	80.80%	484'818.00	0.09	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.
US836205AT15	4.8750 % SOAF 4 7/8 04/14/26	800	0	200	600 USD	98.80%	592'818.00	0.12	a)
US836205AU87	4.3000 % SOAF 4.3 10/12/28	1'000	0	0	1'000 USD	94.93%	949'280.00	0.18	a)
US836205AV60	5.0000 % SOAF 5 10/12/46	600	0	0	600 USD	75.18%	451'068.00	0.09	a)
US836205AW44	4.8500 % SOAF 4.85 09/27/27	600	0	0	600 USD	98.68%	592'068.00	0.12	a)
US836205AX27	5.6500 % SOAF 5.65 09/27/47	650	400	0	1'050 USD	80.68%	847'119.00	0.16	a)
US836205AY00	5.8750 % SOAF 5 7/8 06/22/30	800	200	0	1'000 USD	98.75%	987'500.00	0.19	a)
US836205AZ74	6.3000 % SOAF 6.3 06/22/48	400	0	0	400 USD	86.63%	346'500.00	0.07	a)
US836205BA15	4.8500 % SOAF 4.85 09/30/29	1'000	200	0	1'200 USD	95.43%	1'145'136.00	0.22	a)
US836205BB97	5.7500 % SOAF 5 3/4 09/30/49	1'650	400	200	1'850 USD	80.50%	1'489'250.00	0.29	a)
US836205BC70	5.8750 % SOAF 5 7/8 04/20/32	700	200	0	900 USD	97.25%	875'277.00	0.17	a)
US836205BE37	7.3000 % SOAF 7.3 04/20/52	800	200	0	1'000 USD	96.25%	962'500.00	0.19	a)
US857524AD47	5.5000 % POLAND 5 1/2 11/16/27	1'010	0	0	1'010 USD	104.14%	1'051'854.40	0.20	a)
US857524AE20	5.7500 % POLAND 5 3/4 11/16/32	1'050	0	60	990 USD	107.34%	1'062'616.50	0.21	a)
US900123AL40	11.8750 % TURKEY 11 7/8 01/15/30 30Y	350	0	0	350 USD	127.56%	446'468.75	0.09	a)
US900123AT75	8.0000 % TURKEY 8 02/14/34 30Y	300	100	0	400 USD	107.63%	430'500.00	0.08	a)
US900123AW05	7.3750 % TURKEY 7 3/8 02/05/25 20Y	800	0	0	800 USD	100.75%	806'000.00	0.16	a)
US900123AY60	6.8750 % TURKEY 6 7/8 03/17/36 30Y	770	100	200	670 USD	97.00%	649'900.00	0.13	a)
US900123BB58	7.2500 % TURKEY 7 1/4 03/05/38 30Y	200	150	0	350 USD	101.25%	354'375.00	0.07	a)
US900123BG46	6.7500 % TURKEY 6 3/4 05/30/40 30Y	450	100	0	550 USD	93.97%	516'828.13	0.10	a)
US900123BJ84	6.0000 % TURKEY 6 01/14/41 30Y	800	200	250	750 USD	86.03%	645'234.38	0.13	a)
US900123CB40	4.8750 % TURKEY 4 7/8 04/16/43 30Y	650	200	0	850 USD	73.38%	623'687.50	0.12	a)
US900123CG37	6.6250 % TURKEY 6 5/8 02/17/45 31Y	800	200	200	800 USD	88.69%	709'500.00	0.14	a)
US900123CJ75	4.2500 % TURKEY 4 1/4 04/14/26 11Y	400	200	200	400 USD	98.34%	393'375.00	0.08	a)
US900123CK49	4.8750 % TURKEY 4 7/8 10/09/26 11Y	800	0	0	800 USD	98.78%	790'250.00	0.15	a)
US900123CL22	6.0000 % TURKEY 6 03/25/27 10Y	600	0	0	600 USD	100.72%	604'312.50	0.12	a)
US900123CM05	5.7500 % TURKEY 5 3/4 05/11/47 30Y	850	0	0	850 USD	79.00%	671'500.00	0.13	a)
US900123CP36	5.1250 % TURKEY 5 1/8 02/17/28 10Y	400	0	0	400 USD	97.59%	390'375.00	0.08	a)
US900123CQ19	6.1250 % TURKEY 6 1/8 10/24/28 11Y	600	0	0	600 USD	100.31%	601'875.00	0.12	a)
US900123CT57	7.6250 % TURKEY 7 5/8 04/26/29 10Y	600	200	0	800 USD	104.56%	836'440.00	0.16	a)
US900123CW86	5.6000 % TURKEY 5.6 11/14/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US900123CX69	4.2500 % TURKEY 4 1/4 03/13/25 5Y	400	0	0	400 USD	99.26%	397'024.00	0.08	a)
US900123CY43	5.2500 % TURKEY 5 1/4 03/13/30 10Y	400	200	0	600 USD	94.71%	568'230.00	0.11	a)
US900123CZ18	6.3750 % TURKEY 6 3/8 10/14/25 5Y	600	0	0	600 USD	101.00%	606'000.00	0.12	a)
US900123DA57	5.9500 % TURKEY 5.95 01/15/31 10Y	500	0	0	500 USD	95.75%	478'750.00	0.09	a)
US900123DB31	4.7500 % TURKEY 4 3/4 01/26/26 5Y	300	200	0	500 USD	99.13%	495'625.00	0.10	a)
US900123DC14	5.8750 % TURKEY 5 7/8 06/26/31 10Y	400	0	0	400 USD	94.50%	378'000.00	0.07	a)
US900123DD96	6.5000 % TURKEY 6 1/2 09/20/33 12Y	400	0	0	400 USD	96.38%	385'500.00	0.07	a)
US900123DF45	9.8750 % TURKEY 9 7/8 01/15/28 5Y	900	0	0	900 USD	111.38%	1'002'375.00	0.19	a)
US900123DG28	9.3750 % TURKEY 9 3/8 01/19/33 10Y	600	200	0	800 USD	114.63%	917'000.00	0.18	a)
US900123DH01	9.3750 % TURKEY 9 3/8 03/14/29 6Y	600	200	200	600 USD	111.63%	669'750.00	0.13	a)
US900123DJ66	9.1250 % TURKEY 9 1/8 07/13/30 7Y	550	0	0	550 USD	111.63%	613'937.50	0.12	a)
US900123DK30	7.6250 % TURKEY 7 5/8 05/15/34 10Y	850	850	0	850 USD	104.00%	884'000.00	0.17	a)
US900123DL13	7.1250 % TURKEY 7 1/8 07/17/32	0	200	0	200 USD	100.75%	201'500.00	0.04	a)
US91086QAG38	8.3000 % MEX 8.3 08/15/31 MTN	200	0	0	200 USD	120.09%	240'187.50	0.05	a)
US91086QAN88	7.5000 % MEX 7 1/2 04/08/33 MTNA	150	0	0	150 USD	113.69%	170'531.25	0.03	a)
US91086QAS75	6.7500 % MEX 6 3/4 09/27/34 MTNA	300	0	0	300 USD	107.34%	322'031.25	0.06	a)
US91086QAV05	6.0500 % MEX 6.05 01/11/40	500	100	0	600 USD	100.13%	600'750.00	0.12	a)
US91086QAZ19	5.7500 % MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN	460	140	0	600 USD	85.63%	513'750.00	0.10	a)
US91086QBB32	4.7500 % MEX 4 3/4 03/08/44 MTN	700	0	0	700 USD	83.31%	583'187.50	0.11	a)
US91086QBE70	5.5500 % MEX 5.55 01/21/45	520	200	180	540 USD	93.63%	505'575.00	0.10	a)
US91086QBF46	4.6000 % MEX 4.6 01/23/46	400	200	0	600 USD	80.00%	480'000.00	0.09	a)
US91086QBG29	4.1250 % MEX 4 1/8 01/21/26	250	200	0	450 USD	99.13%	446'062.50	0.09	a)
US91087BAB62	4.3500 % MEX 4.35 01/15/47	200	0	0	200 USD	77.59%	155'187.50	0.03	a)
US91087BAC46	4.1500 % MEX 4.15 03/28/27	400	200	0	600 USD	98.72%	592'312.50	0.12	a)
US91087BAD29	4.6000 % MEX 4.6 02/10/48	400	200	200	400 USD	79.25%	317'000.00	0.06	a)
US91087BAE02	3.7500 % MEX 3 3/4 01/11/28	400	200	200	400 USD	96.78%	387'125.00	0.08	a)
US91087BAF76	4.5000 % MEX 4 1/2 04/22/29	400	200	0	600 USD	97.94%	587'628.00	0.11	a)
US91087BAG59	4.5000 % MEX 4 1/2 01/31/50	400	0	0	400 USD	78.38%	313'500.00	0.06	a)
US91087BAH33	3.2500 % MEX 3 1/4 04/16/30	400	0	0	400 USD	90.75%	363'000.00	0.07	a)
US91087BAJ98	3.9000 % MEX 3.9 04/27/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91087BAK61	4.7500 % MEX 4 3/4 04/27/32	500	400	400	500 USD	95.28%	476'406.25	0.09	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.
US91087BAL45	5.0000 % MEX 5 04/27/51	400	200	0	600 USD	83.06%	498'375.00	0.10	a)
US91087BAM28	2.6590 % MEX 2.659 05/24/31	600	0	0	600 USD	84.94%	509'625.00	0.10	a)
US91087BAN01	3.7710 % MEX 3.771 05/24/61	600	0	0	600 USD	64.34%	386'062.50	0.08	a)
US91087BAQ32	4.2800 % MEX 4.28 08/14/41	560	200	200	560 USD	80.69%	451'850.00	0.09	a)
US91087BAR15	3.5000 % MEX 3 1/2 02/12/34	500	400	200	700 USD	84.25%	589'750.00	0.11	a)
US91087BAS97	4.4000 % MEX 4.4 02/12/52	400	0	0	400 USD	75.97%	303'875.00	0.06	a)
US91087BAT70	4.8750 % MEX 4 7/8 05/19/33	400	0	0	400 USD	94.88%	379'500.00	0.07	a)
US91087BAU44	5.4000 % MEX 5.4 02/09/28	300	0	0	300 USD	101.63%	304'875.00	0.06	a)
US91087BAV27	6.3500 % MEX 6.35 02/09/35	600	200	200	600 USD	103.94%	623'625.00	0.12	a)
US91087BAX82	6.3380 % MEX 6.338 05/04/53	400	200	0	600 USD	98.22%	589'312.50	0.11	a)
US91087BAY65	5.0000 % MEX 5 05/07/29	200	0	0	200 USD	99.97%	199'937.50	0.04	a)
US91087BAZ31	6.0000 % MEX 6 05/07/36	600	200	0	800 USD	100.94%	807'500.00	0.16	a)
US91087BBA70	6.4000 % MEX 6.4 05/07/54	400	200	0	600 USD	99.06%	594'375.00	0.12	a)
US917288BA96	7.8750 % URUGUA 7 7/8 01/15/33	500	100	0	600 USD	121.56%	729'375.00	0.14	a)
US917288BK78	4.3750 % URUGUA 4 3/8 01/23/31	1'320	200	0	1'520 USD	100.56%	1'528'550.00	0.30	a)
USC7274KAB29	2.1120 % PETMK 2.112 03/23/28 REGS	400	0	0	400 USD	92.07%	368'292.00	0.07	a)
USG13201AA91	5.3330 % MINASG 5.333 02/15/28 REGS	400	0	0	400 USD	99.34%	158'950.40	0.03	a)
USG5852MAA02	9.8750 % MVMOFB 9 7/8 04/08/26 REGS	300	0	0	300 USD	68.56%	205'689.00	0.04	a)
USG8185TAB55	6.3000 % SINOCH 6.3 11/12/40 REGS	100	0	0	100 USD	110.10%	110'095.00	0.02	a)
USG8189YAC87	4.8750 % SINOPE 4 7/8 05/17/42 REGS	200	0	0	200 USD	99.51%	199'022.00	0.04	a)
USG8200QAC09	5.3750 % SINOPE 5 3/8 10/17/43 REGS	200	0	0	200 USD	106.65%	213'302.00	0.04	a)
USG8200TAD21	3.5000 % SINOPE 3 1/2 05/03/26 REGS	200	0	0	200 USD	98.56%	197'126.00	0.04	a)
USG8200TAH35	2.7500 % SINOPE 2 3/4 09/29/26 REGS	0	200	0	200 USD	96.86%	193'716.00	0.04	a)
USG82016AC32	4.2500 % SINOPE 4 1/4 09/12/28 REGS	200	0	0	200 USD	100.21%	200'426.00	0.04	a)
USG82016AH29	2.9500 % SINOPE 2.95 08/08/29 REGS	200	0	0	200 USD	94.65%	189'296.00	0.04	a)
USG82016AJ84	3.6800 % SINOPE 3.68 08/08/49 REGS	200	0	0	200 USD	83.35%	166'702.00	0.03	a)
USG82016AK57	2.5000 % SINOPE 2 1/2 11/12/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG82016AL31	2.9500 % SINOPE 2.95 11/12/29 REGS	200	200	0	400 USD	94.39%	377'568.00	0.07	a)
USG82016AN96	2.1500 % SINOPE 2.15 05/13/25 REGS	200	0	0	200 USD	97.90%	195'792.00	0.04	a)
USG82016AP45	2.7000 % SINOPE 2.7 05/13/30 REGS	400	0	0	400 USD	93.31%	373'240.00	0.07	a)
USG82016AQ28	3.3500 % SINOPE 3.35 05/13/50 REGS	0	200	0	200 USD	77.53%	155'060.00	0.03	a)
USG82016AR01	1.4500 % SINOPE 1.45 01/08/26 REGS	400	0	0	400 USD	95.85%	383'408.00	0.07	a)
USG82016AS83	2.3000 % SINOPE 2.3 01/08/31 REGS	200	200	0	400 USD	88.97%	355'860.00	0.07	a)
USG82016AT66	3.1000 % SINOPE 3.1 01/08/51 REGS	200	0	0	200 USD	73.57%	147'138.00	0.03	a)
USG8201JAC56	3.2500 % SINOPE 3 1/4 04/28/25 REGS	400	0	0	400 USD	98.72%	394'892.00	0.08	a)
USG8201JAE13	4.1000 % SINOPE 4.1 04/28/45 REGS	200	0	0	200 USD	89.48%	178'968.00	0.03	a)
USG8201NAC68	3.6250 % SINOPE 3 5/8 04/12/27 REGS	200	200	0	400 USD	98.35%	393'384.00	0.08	a)
USG8201NAH55	3.2500 % SINOPE 3 1/4 09/13/27 REGS	200	0	0	200 USD	97.05%	194'090.00	0.04	a)
USG8449VAC03	4.3750 % CHGRID 4 3/8 05/22/43 REGS	200	0	0	200 USD	95.31%	190'612.00	0.04	a)
USG8449WAD68	4.8500 % CHGRID 4.85 05/07/44 REGS	200	0	0	200 USD	101.19%	202'372.00	0.04	a)
USG8450LAC84	2.8750 % CHGRID 2 7/8 05/18/26 REGS	200	0	0	200 USD	97.43%	194'862.00	0.04	a)
USG8450LAJ38	3.5000 % CHGRID 3 1/2 05/04/27 REGS	800	0	200	600 USD	98.16%	588'984.00	0.11	a)
USG8450LAP97	4.2500 % CHGRID 4 1/4 05/02/28 REGS	200	0	0	200 USD	100.19%	200'384.00	0.04	a)
USG8850LAA82	3.7000 % YANTZE 3.7 06/10/25 REGS	250	0	0	250 USD	99.13%	247'812.50	0.05	a)
USG8850LAC49	3.1500 % YANTZE 3.15 06/02/26 REGS	400	0	0	400 USD	97.97%	391'875.00	0.08	a)
USM88269US88	8.6000 % TURKEY 8.6 09/24/27 6Y	400	200	0	600 USD	107.75%	646'500.00	0.13	a)
USP0092AAF68	4.0000 % AITOCU 4 08/11/41 REGS	200	0	0	200 USD	80.33%	160'656.00	0.03	a)
USP0092AAG42	5.1250 % AITOCU 5 1/8 08/11/61 REGS	600	0	0	600 USD	78.56%	471'378.00	0.09	a)
USP01012AN67	7.6500 % ELSALV 7.65 06/15/35 REGS	540	200	0	740 USD	78.35%	579'790.00	0.11	a)
USP01012AR71	7.6250 % ELSALV 7 5/8 02/01/41 REGS	500	150	150	500 USD	73.75%	368'750.00	0.07	a)
USP01012AT38	6.3750 % ELSALV 6 3/8 01/18/27 REGS	520	0	0	520 USD	93.69%	487'175.00	0.09	a)
USP01012BX31	8.6250 % ELSALV 8 5/8 02/28/29 REGS	410	0	101	309 USD	93.65%	289'378.50	0.06	a)
USP01012CA29	7.1246 % ELSALV 7.1246 01/20/50 REGS	750	0	0	750 USD	69.28%	519'607.50	0.10	a)
USP01012CC84	9.5000 % ELSALV 9 1/2 07/15/52 REGS	650	0	0	650 USD	84.75%	550'875.00	0.11	a)
USP01012CF16	9.2500 % ELSALV 9 1/4 04/17/30 REGS	0	700	0	700 USD	94.75%	663'250.00	0.13	a)
USP1027DHQ71	7.9500 % BANCO 7.95 PERP REGS	0	200	0	200 USD	105.75%	211'500.00	0.04	a)
USP14517AA73	4.3750 % BNCE 4 3/8 10/14/25 REGS	200	0	0	200 USD	99.19%	198'376.00	0.04	a)
USP1451JAA18	2.7200 % BNCE 2.72 08/11/31 REGS	0	200	0	200 USD	90.74%	181'480.00	0.04	a)
USP1559LAA72	2.5000 % BCNAL 2 1/2 08/11/30 REGS	400	0	0	400 USD	81.69%	326'752.00	0.06	a)
USP29595AD08	3.3480 % CFELEC 3.348 02/09/31 REGS	200	0	0	200 USD	86.09%	172'187.50	0.03	a)
USP29595AE80	4.6770 % CFELEC 4.677 02/09/51 REGS	200	0	0	200 USD	74.38%	148'750.00	0.03	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.
USP30179BK34	3.8750 % CFELEC 3 7/8 07/26/33 REGS	400	0	0	400 USD	84.31%	337'252.00	0.07	a)
USP30179BQ04	4.6880 % CFELEC 4.688 05/15/29 REGS	200	0	0	200 USD	96.34%	192'687.50	0.04	a)
USP30179BR86	6.2640 % CFELEC 6.264 02/15/52 REGS	200	0	0	200 USD	90.25%	180'500.00	0.04	a)
USP3143NAG99	5.6250 % CDEL 5 5/8 09/21/35 REGS	200	0	0	200 USD	101.75%	203'500.00	0.04	a)
USP3143NAH72	6.1500 % CDEL 6.15 10/24/36 REGS	100	0	0	100 USD	105.13%	105'125.00	0.02	a)
USP3143NAQ71	4.2500 % CDEL 4 1/4 07/17/42 REGS	200	0	0	200 USD	82.19%	164'375.00	0.03	a)
USP3143NAS38	5.6250 % CDEL 5 5/8 10/18/43 REGS	400	0	0	400 USD	96.75%	387'000.00	0.08	a)
USP3143NAU83	4.8750 % CDEL 4 7/8 11/04/44 REGS	200	0	0	200 USD	88.00%	176'000.00	0.03	a)
USP3143NAY06	3.6250 % CDEL 3 5/8 08/01/27 REGS	400	0	0	400 USD	96.19%	384'750.00	0.07	a)
USP3143NAZ70	4.5000 % CDEL 4 1/2 08/01/47 REGS	400	0	0	400 USD	83.34%	333'375.00	0.06	a)
USP3143NBB93	4.3750 % CDEL 4 3/8 02/05/49 REGS	400	0	0	400 USD	81.41%	325'625.00	0.06	a)
USP3143NBE33	3.0000 % CDEL 3 09/30/29 REGS	400	200	200	400 USD	90.78%	363'125.00	0.07	a)
USP3143NBF08	3.7000 % CDEL 3.7 01/30/50 REGS	800	200	0	1'000 USD	72.66%	726'562.50	0.14	a)
USP3143NBH63	3.1500 % CDEL 3.15 01/14/30 REGS	400	0	0	400 USD	90.81%	363'250.00	0.07	a)
USP3143NBK92	3.7500 % CDEL 3 3/4 01/15/31 REGS	200	0	0	200 USD	92.00%	184'000.00	0.04	a)
USP3143NBM58	3.1500 % CDEL 3.15 01/15/51 REGS	200	0	0	200 USD	66.19%	132'375.00	0.03	a)
USP3143NBP89	5.1250 % CDEL 5 1/8 02/02/33 REGS	300	0	0	300 USD	98.34%	295'031.25	0.06	a)
USP3143NBQ62	5.9500 % CDEL 5.95 01/08/34 REGS	300	200	0	500 USD	103.75%	518'750.00	0.10	a)
USP3143NBR46	6.3000 % CDEL 6.3 09/08/53 REGS	200	200	0	400 USD	103.97%	415'875.00	0.08	a)
USP3143NBT02	6.4400 % CDEL 6.44 01/26/36 REGS	0	600	0	600 USD	107.22%	643'312.50	0.13	a)
USP3579EAY34	7.4500 % DOMREP 7.45 04/30/44 REGS	800	150	0	950 USD	111.72%	1'061'330.50	0.21	a)
USP3579EBD87	5.5000 % DOMREP 5 1/2 01/27/25 REGS	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP3579EBE60	6.8500 % DOMREP 6.85 01/27/45 REGS	950	200	0	1'150 USD	105.19%	1'209'662.00	0.24	a)
USP3579EBK21	6.8750 % DOMREP 6 7/8 01/29/26 REGS	750	100	0	850 USD	101.69%	864'343.75	0.17	a)
USP3579EBV85	5.9500 % DOMREP 5.95 01/25/27 REGS	900	150	0	1'050 USD	100.88%	1'059'187.50	0.21	a)
USP3579EBY25	6.5000 % DOMREP 6 1/2 02/15/48 REGS	550	0	0	550 USD	101.19%	556'534.00	0.11	a)
USP3579ECB13	6.0000 % DOMREP 6 07/19/28 REGS	650	150	0	800 USD	101.94%	815'504.00	0.16	a)
USP3579ECE51	6.4000 % DOMREP 6.4 06/05/49 REGS	750	150	0	900 USD	100.19%	901'692.00	0.18	a)
USP3579ECF27	4.5000 % DOMREP 4 1/2 01/30/30 REGS	1'150	150	150	1'150 USD	94.72%	1'089'291.50	0.21	a)
USP3579ECG00	5.8750 % DOMREP 5 7/8 01/30/60 REGS	1'730	350	200	1'880 USD	91.80%	1'725'840.00	0.34	a)
USP3579ECH82	4.8750 % DOMREP 4 7/8 09/23/32 REGS	1'650	200	0	1'850 USD	94.13%	1'741'312.50	0.34	a)
USP3579ECJ49	5.3000 % DOMREP 5.3 01/21/41 REGS	850	200	150	900 USD	90.78%	817'029.00	0.16	a)
USP3579ECN50	6.0000 % DOMREP 6 02/22/33 REGS	900	150	0	1'050 USD	101.03%	1'060'825.50	0.21	a)
USP3579ECP09	5.5000 % DOMREP 5 1/2 02/22/29 REGS	900	150	0	1'050 USD	100.13%	1'051'312.50	0.20	a)
USP3579ECR64	7.0500 % DOMREP 7.05 02/03/31 REGS	350	350	0	700 USD	107.05%	749'350.00	0.15	a)
USP3579ECU93	6.6000 % DOMREP 6.6 06/01/36 REGS	0	450	0	450 USD	105.10%	472'950.00	0.09	a)
USP3699PGE18	4.3750 % COSTAR 4 3/8 04/30/25 REGS	400	0	200	200 USD	99.20%	198'400.00	0.04	a)
USP3699PGF82	5.6250 % COSTAR 5 5/8 04/30/43 REGS	400	200	200	400 USD	92.50%	370'000.00	0.07	a)
USP3699PGH49	7.0000 % COSTAR 7 04/04/44 REGS	600	0	0	600 USD	105.20%	631'218.00	0.12	a)
USP3699PGJ05	7.1580 % COSTAR 7.158 03/12/45 REGS	800	0	0	800 USD	106.78%	854'248.00	0.17	a)
USP3699PGK77	6.1250 % COSTAR 6 1/8 02/19/31 REGS	800	0	0	800 USD	103.13%	825'000.00	0.16	a)
USP3699PGM34	6.5500 % COSTAR 6.55 04/03/34 REGS	850	200	0	1'050 USD	105.34%	1'106'112.00	0.22	a)
USP3699PGN17	7.3000 % COSTAR 7.3 11/13/54 REGS	1'050	0	0	1'050 USD	108.28%	1'136'950.50	0.22	a)
USP37110AK24	3.7500 % ENAPCL 3 3/4 08/05/26 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP37110AM89	4.5000 % ENAPCL 4 1/2 09/14/47 REGS	200	0	0	200 USD	79.09%	158'188.00	0.03	a)
USP37110AN62	5.2500 % ENAPCL 5 1/4 11/06/29 REGS	200	0	0	200 USD	99.78%	199'562.00	0.04	a)
USP37110AR76	3.4500 % ENAPCL 3.45 09/16/31 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP37110AS59	6.1500 % ENAPCL 6.15 05/10/33 REGS	200	0	0	200 USD	104.50%	209'000.00	0.04	a)
USP37110AT33	5.9500 % ENAPCL 5.95 07/30/34 REGS	0	250	0	250 USD	103.75%	259'375.00	0.05	a)
USP37146AA81	5.1250 % EMTESA 5 1/8 05/02/49 REGS	200	0	0	200 USD	76.50%	153'000.00	0.03	a)
USP3742RAW09	3.0680 % BFFCC 3.068 08/18/50 REGS	200	0	0	200 USD	62.78%	125'562.50	0.02	a)
USP3742RAX81	3.8300 % BFFCC 3.83 09/14/61 REGS	200	0	0	200 USD	68.59%	137'187.50	0.03	a)
USP37466AP78	5.0000 % BMETR 5 01/25/47 REGS	200	0	0	200 USD	89.19%	178'375.00	0.03	a)
USP37466AR35	3.6500 % BMETR 3.65 05/07/30 REGS	200	0	0	200 USD	92.81%	185'625.00	0.04	a)
USP37466AS18	4.7000 % BMETR 4.7 05/07/50 REGS	200	200	0	400 USD	85.13%	340'500.00	0.07	a)
USP37466AT90	3.6930 % BMETR 3.693 09/13/61 REGS	200	0	0	200 USD	68.34%	136'687.50	0.03	a)
USP37878AC26	4.5000 % BOLIVI 4 1/2 03/20/28 REGS	600	0	0	600 USD	54.99%	329'940.00	0.06	a)
USP37878AE81	7.5000 % BOLIVI 7 1/2 03/02/30 REGS	650	0	0	650 USD	55.58%	361'257.00	0.07	a)
USP3R94GAY57	2.4000 % COFIDE 2.4 09/28/27 REGS	200	200	0	400 USD	92.94%	371'752.00	0.07	a)
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	300	0	0	300 USD	98.75%	296'250.00	0.06	a)
USP48864AQ80	6.5000 % BARBAD 6 1/2 10/01/29 REGS	300	100	0	400 USD	95.75%	383'000.00	0.07	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.
USP5015VAE67	4.8750 % GUATEM 4 7/8 02/13/28 REGS	400	0	0	400 USD	98.34%	393'375.00	0.08	a)
USP5015VAF33	4.5000 % GUATEM 4 1/2 05/03/26 REGS	400	200	0	600 USD	98.34%	590'062.50	0.11	a)
USP5015VAG16	4.3750 % GUATEM 4 3/8 06/05/27 REGS	400	0	0	400 USD	97.44%	389'750.00	0.08	a)
USP5015VAH98	4.9000 % GUATEM 4.9 06/01/30 REGS	400	0	0	400 USD	97.38%	389'500.00	0.08	a)
USP5015VAJ54	6.1250 % GUATEM 6 1/8 06/01/50 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	95.06%	950'625.00	0.18	a)
USP5015VAK28	5.3750 % GUATEM 5 3/8 04/24/32 REGS	200	200	0	400 USD	98.40%	393'600.00	0.08	a)
USP5015VAM83	3.7000 % GUATEM 3.7 10/07/33 REGS	300	0	0	300 USD	85.13%	255'375.00	0.05	a)
USP5015VAN66	4.6500 % GUATEM 4.65 10/07/41 REGS	400	200	200	400 USD	82.31%	329'250.00	0.06	a)
USP5015VAP15	5.2500 % GUATEM 5 1/4 08/10/29 REGS	250	0	0	250 USD	98.65%	246'612.50	0.05	a)
USP5015VAQ97	6.6000 % GUATEM 6.6 06/13/36 REGS	700	0	0	700 USD	104.30%	730'107.00	0.14	a)
USP5015VAR70	7.0500 % GUATEM 7.05 10/04/32 REGS	400	0	0	400 USD	107.69%	430'750.00	0.08	a)
USP5015VAS53	6.5500 % GUATEM 6.55 02/06/37 REGS	0	600	0	600 USD	103.00%	617'970.00	0.12	a)
USP5015VAT37	6.0500 % GUATEM 6.05 08/06/31 REGS	0	400	0	400 USD	101.95%	407'816.00	0.08	a)
USP5076HAA16	9.0000 % TPHLT 9 08/12/29 REGS	400	0	0	400 USD	104.44%	417'752.00	0.08	a)
USP5178RAC27	6.2500 % HONDUR 6 1/4 01/19/27 REGS	500	0	0	500 USD	96.85%	484'250.00	0.09	a)
USP5178RAD00	5.6250 % HONDUR 5 5/8 06/24/30 REGS	350	0	0	350 USD	88.50%	309'750.00	0.06	a)
USP56226AQ94	6.3750 % COSICE 6 3/8 05/15/43 REGS	400	0	0	400 USD	90.19%	360'750.00	0.07	a)
USP6629MAA01	4.2500 % MEXCAT 4 1/4 10/31/26 REGS	200	0	0	200 USD	97.50%	195'000.00	0.04	a)
USP6629MAB83	5.5000 % MEXCAT 5 1/2 10/31/46 REGS	200	0	0	200 USD	85.36%	170'716.00	0.03	a)
USP6629MAD40	5.5000 % MEXCAT 5 1/2 07/31/47 REGS	400	0	0	400 USD	85.44%	341'750.00	0.07	a)
USP68788AC53	7.9500 % SURINM 7.95 07/15/33 REGS	322	157	0	479 USD	96.63%	462'648.23	0.09	a)
USP75744AB11	6.1000 % PARGUY 6.1 08/11/44 REGS	600	0	0	600 USD	100.94%	605'625.00	0.12	a)
USP75744AE59	4.7000 % PARGUY 4.7 03/27/27 REGS	400	0	0	400 USD	99.69%	398'750.00	0.08	a)
USP75744AF25	5.6000 % PARGUY 5.6 03/13/48 REGS	400	0	0	400 USD	93.81%	375'252.00	0.07	a)
USP75744AG08	5.4000 % PARGUY 5.4 03/30/50 REGS	800	0	0	800 USD	91.60%	732'768.00	0.14	a)
USP75744AJ47	4.9500 % PARGUY 4.95 04/28/31 REGS	600	0	0	600 USD	98.81%	592'875.00	0.12	a)
USP75744AK10	2.7390 % PARGUY 2.739 01/29/33 REGS	400	0	0	400 USD	84.25%	337'000.00	0.07	a)
USP75744AL92	3.8490 % PARGUY 3.849 06/28/33 REGS	280	0	0	280 USD	90.66%	253'837.50	0.05	a)
USP75744AM75	5.8500 % PARGUY 5.85 08/21/33 REGS	400	200	200	400 USD	103.13%	412'500.00	0.08	a)
USP75744AN58	6.0000 % PARGUY 6 02/09/36 REGS	0	400	0	400 USD	104.31%	417'252.00	0.08	a)
USP7808BAA54	4.7500 % PETRPE 4 3/4 06/19/32 REGS	600	0	0	600 USD	74.88%	449'250.00	0.09	a)
USP7808BAB38	5.6250 % PETRPE 5 5/8 06/19/47 REGS	900	200	0	1'100 USD	63.09%	693'957.00	0.13	a)
USP93960AG08	4.5000 % TRITOB 4 1/2 08/04/26 REGS	600	0	0	600 USD	98.25%	589'500.00	0.11	a)
USP93960AH80	4.5000 % TRITOB 4 1/2 06/26/30 REGS	400	0	0	400 USD	94.09%	376'375.00	0.07	a)
USP93960AJ47	5.9500 % TRITOB 5.95 01/14/31 REGS	300	0	0	300 USD	101.06%	303'187.50	0.06	a)
USP93960AK10	6.4000 % TRITOB 6.4 06/26/34 REGS	0	500	0	500 USD	102.15%	510'750.00	0.10	a)
USP9400VAA90	5.2500 % TRNGEN 5 1/4 11/04/27 REGS	400	0	0	400 USD	97.35%	389'400.00	0.08	a)
USY15025AB84	0.5500 % CHINA 0.55 10/21/25 REGS	600	0	0	600 USD	95.97%	575'814.00	0.11	a)
USY15025AC67	1.2000 % CHINA 1.2 10/21/30 REGS	400	200	0	600 USD	86.24%	517'410.00	0.10	a)
USY15025AD41	2.2500 % CHINA 2 1/4 10/21/50 REGS	200	0	0	200 USD	67.88%	135'760.00	0.03	a)
USY20721AE96	8.5000 % INDON 8 1/2 10/12/35 REGS	300	150	0	450 USD	130.03%	585'112.50	0.11	a)
USY20721AJ83	6.6250 % INDON 6 5/8 02/17/37 REGS	300	0	0	300 USD	114.81%	344'437.50	0.07	a)
USY20721AL30	7.7500 % INDON 7 3/4 01/17/38 REGS	400	0	0	400 USD	126.59%	506'375.00	0.10	a)
USY20721BB49	5.2500 % INDON 5 1/4 01/17/42 REGS	400	200	0	600 USD	102.56%	615'375.00	0.12	a)
USY20721BE87	4.6250 % INDON 4 5/8 04/15/43 REGS	400	200	200	400 USD	95.69%	382'750.00	0.07	a)
USY20721BG36	4.1250 % INDON 4 1/8 01/15/25 REGS	400	0	0	400 USD	99.81%	399'228.00	0.08	a)
USY20721BK48	6.7500 % INDON 6 3/4 01/15/44 REGS	400	200	0	600 USD	120.50%	723'000.00	0.14	a)
USY20721BM04	5.1250 % INDON 5 1/8 01/15/45 REGS	400	200	0	600 USD	101.28%	607'698.00	0.12	a)
USY20721BN86	4.7500 % INDON 4 3/4 01/08/26 REGS	400	0	0	400 USD	100.47%	401'875.00	0.08	a)
USY20721BP35	5.9500 % INDON 5.95 01/08/46 REGS	200	0	0	200 USD	110.25%	220'500.00	0.04	a)
USY20721BQ18	4.3500 % INDON 4.35 01/08/27 REGS	400	200	200	400 USD	99.88%	399'500.00	0.08	a)
USY20721BR90	5.2500 % INDON 5 1/4 01/08/47 REGS	400	0	0	400 USD	102.53%	410'125.00	0.08	a)
USY20721BT56	3.8500 % INDON 3.85 07/18/27 REGS	200	0	0	200 USD	98.63%	197'250.00	0.04	a)
USY20721BU20	4.7500 % INDON 4 3/4 07/18/47 REGS	200	0	0	200 USD	96.94%	193'875.00	0.04	a)
USY5325QAD44	0.7500 % CHINA 0 3/4 10/26/24 REGS	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY5325QAE27	1.2500 % CHINA 1 1/4 10/26/26 REGS	500	0	0	500 USD	94.39%	471'960.00	0.09	a)
USY5325QAF91	1.7500 % CHINA 1 3/4 10/26/31 REGS	400	0	200	200 USD	87.13%	174'250.00	0.03	a)
USY54788AA57	3.1790 % MALAYS 3.179 04/27/26 REGS	750	250	250	750 USD	98.17%	736'237.50	0.14	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.
USY54788AB31	4.0800 % MALAYS 4.08 04/27/46 REGS	250	0	0	250 USD	90.46%	226'145.00	0.04	a)
USY5749LAA99	3.0430 % MALAYS 3.043 04/22/25 REGS	600	0	0	600 USD	98.87%	593'190.00	0.12	a)
USY5749LAB72	4.2360 % MALAYS 4.236 04/22/45 REGS	400	0	0	400 USD	93.01%	372'032.00	0.07	a)
USY57542AA32	2.0700 % MALAYS 2.07 04/28/31 REGS	500	0	0	500 USD	86.92%	434'610.00	0.08	a)
USY57542AB15	3.0750 % MALAYS 3.075 04/28/51 REGS	250	0	0	250 USD	74.39%	185'977.50	0.04	a)
USY6142NAC21	5.1250 % MONGOL 5 1/8 04/07/26 REGS	400	0	0	400 USD	97.38%	389'500.00	0.08	a)
USY6142NAE86	4.4500 % MONGOL 4.45 07/07/31 REGS	400	0	0	400 USD	87.13%	348'500.00	0.07	a)
USY6142NAF51	3.5000 % MONGOL 3 1/2 07/07/27 REGS	200	0	0	200 USD	91.47%	182'938.00	0.04	a)
USY6142NAG35	8.6500 % MONGOL 8.65 01/19/28 REGS	420	0	0	420 USD	105.56%	443'362.50	0.09	a)
USY67265AP66	8.3750 % PNGIB 8 3/8 10/04/28 REGS	400	0	0	400 USD	96.94%	387'752.00	0.08	a)
USY68613AA90	5.1000 % INDOIS 5.1 07/02/29 REGS	0	200	0	200 USD	102.84%	205'688.00	0.04	a)
USY68613AB73	5.2000 % INDOIS 5.2 07/02/34 REGS	0	200	0	200 USD	103.69%	207'370.00	0.04	a)
USY68613AC56	5.5000 % INDOIS 5 1/2 07/02/54 REGS	0	200	0	200 USD	105.94%	211'880.00	0.04	a)
USY68851AK32	7.6250 % PETMK 7 5/8 10/15/26 REGS	300	0	0	300 USD	105.90%	317'703.00	0.06	a)
USY68856AN67	3.5000 % PETMK 3 1/2 03/18/25 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.15%	991'490.00	0.19	a)
USY68856AQ98	4.5000 % PETMK 4 1/2 03/18/45 REGS	1'000	200	200	1'000 USD	90.92%	909'200.00	0.18	a)
USY68856AT38	3.5000 % PETMK 3 1/2 04/21/30 REGS	1'400	200	0	1'600 USD	94.78%	1'516'400.00	0.29	a)
USY68856AV83	4.5500 % PETMK 4.55 04/21/50 REGS	1'900	0	0	1'900 USD	90.64%	1'722'103.00	0.33	a)
USY68856AW66	4.8000 % PETMK 4.8 04/21/60 REGS	600	0	0	600 USD	92.99%	557'922.00	0.11	a)
USY6886MAC48	3.4040 % PETMK 3.404 04/28/61 REGS	1'100	200	0	1'300 USD	70.77%	919'997.00	0.18	a)
USY6886MAE04	2.4800 % PETMK 2.48 01/28/32 REGS	800	0	0	800 USD	85.88%	687'064.00	0.13	a)
USY6972HLP91	4.2000 % PHILIP 4.2 03/29/47	400	0	0	400 USD	87.03%	348'125.00	0.07	a)
USY7083VAD11	7.3900 % PSALM 7.39 12/02/24 REGS	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY7133MAC39	4.2500 % PLBIJ 4 1/4 05/05/25 REGS	400	0	200	200 USD	99.49%	198'970.00	0.04	a)
USY7138AAB62	6.5000 % PERTIJ 6 1/2 05/27/41 REGS	0	200	0	200 USD	111.16%	222'312.00	0.04	a)
USY7138AAD29	6.0000 % PERTIJ 6 05/03/42 REGS	200	0	0	200 USD	104.28%	208'562.00	0.04	a)
USY7138AAF76	5.6250 % PERTIJ 5 5/8 05/20/43 REGS	400	0	0	400 USD	100.69%	402'752.00	0.08	a)
USY7140WAC20	6.5300 % IDASAL 6.53 11/15/28 REGS	200	0	0	200 USD	105.31%	210'625.00	0.04	a)
USY7140WAE85	4.7500 % IDASAL 4 3/4 05/15/25 REGS	200	0	0	200 USD	99.53%	199'062.50	0.04	a)
USY7140WAF50	5.4500 % IDASAL 5.45 05/15/30 REGS	200	0	0	200 USD	100.93%	201'862.00	0.04	a)
USY7140WAG34	5.8000 % IDASAL 5.8 05/15/50 REGS	200	0	0	200 USD	97.66%	195'312.50	0.04	a)
USY7141MAA72	3.7500 % HAKAIJ 3 3/4 05/11/30 REGS	200	0	0	200 USD	94.72%	189'438.00	0.04	a)
USY7329CAA37	5.0450 % PHILIP 5.045 06/06/29 REGS	400	0	0	400 USD	102.25%	409'000.00	0.08	a)
USY8137FAC24	6.1250 % SRILAN 6 1/8 06/03/25 REGS	400	0	0	400 USD	52.81%	211'252.00	0.04	a)
USY8137FAE89	6.8500 % SRILAN 6.85 11/03/25 REGS	1'000	200	200	1'000 USD	53.63%	536'250.00	0.10	a)
USY8137FAF54	6.8250 % SRILAN 6.825 07/18/26 REGS	600	200	0	800 USD	52.81%	422'504.00	0.08	a)
USY8137FAH11	6.2000 % SRILAN 6.2 05/11/27 REGS	900	0	0	900 USD	52.22%	469'971.00	0.09	a)
USY8137FAK40	5.7500 % SRILAN 5 3/4 04/18/23 REGS	750	0	0	750 USD	52.25%	391'875.00	0.08	a)
USY8137FAL23	6.7500 % SRILAN 6 3/4 04/18/28 REGS	800	0	0	800 USD	53.22%	425'752.00	0.08	a)
USY8137FAN88	6.8500 % SRILAN 6.85 03/14/24 REGS	600	0	0	600 USD	52.25%	313'500.00	0.06	a)
USY8137FAP37	7.8500 % SRILAN 7.85 03/14/29 REGS	800	200	0	1'000 USD	53.16%	531'562.50	0.10	a)
USY8137FAQ10	6.3500 % SRILAN 6.35 06/28/24 REGS	200	200	0	400 USD	52.50%	210'000.00	0.04	a)
USY8137FAR92	7.5500 % SRILAN 7.55 03/28/30 REGS	800	200	0	1'000 USD	52.75%	527'500.00	0.10	a)
USY9384RAA87	4.8000 % VIETNM 4.8 11/19/24 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0113419690	9.7500 % QATAR 9 3/4 06/15/30 REGS	550	120	200	470 USD	128.84%	605'565.63	0.12	a)
XS0146173371	8.2500 % ELSALV 8 1/4 04/10/32 REGS	400	0	100	300 USD	85.20%	255'600.00	0.05	a)
XS0250882478	8.2500 % LEBAN 8 1/4 04/12/21 REGS	300	0	0	300 USD	6.25%	18'750.00	0.00	a)
XS0308427581	6.8500 % DPWDU 6.85 07/02/37 REGS	370	0	0	370 USD	113.25%	419'025.00	0.08	a)
XS0468535637	6.4000 % QATAR 6.4 01/20/40 REGS	300	150	0	450 USD	116.97%	526'359.38	0.10	a)
XS0505478684	6.8750 % EGYPT 6 7/8 04/30/40 REGS	300	120	0	420 USD	72.09%	302'793.75	0.06	a)
XS0559237796	6.1000 % LEBAN 6.1 10/04/22 EMTN	950	0	0	950 USD	6.25%	59'375.00	0.01	a)
XS0615236188	5.7500 % QATAR 5 3/4 01/20/42 REGS	200	200	0	400 USD	110.81%	443'250.00	0.09	a)
XS0701227075	6.8750 % MUBAUH 6 7/8 11/01/41 REGS	200	0	0	200 USD	119.66%	239'310.00	0.05	a)
XS0707820659	6.6000 % LEBAN 6.6 11/27/26 GMTN	450	0	0	450 USD	6.25%	28'125.00	0.01	a)
XS0828779594	5.3750 % ZAMBIN 5 3/8 09/20/22 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0859366899	6.7500 % LEBAN 6 3/4 11/29/27 15Y	390	0	0	390 USD	6.25%	24'375.00	0.00	a)
XS0859367194	6.0000 % LEBAN 6 01/27/23 10Y	550	0	0	550 USD	6.25%	34'375.00	0.01	a)
XS0864259717	5.5000 % MOROC 5 1/2 12/11/42 REGS	600	0	0	600 USD	92.50%	555'000.00	0.11	a)
XS0880597603	5.2500 % DUGB 5 1/4 01/30/43 EMTN	200	0	0	200 USD	99.25%	198'500.00	0.04	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.
XS1056386714	8.5000 % ZAMBIN 8 1/2 04/14/24 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1108847531	8.1250 % GHANA 8 1/8 01/18/26 REGS	600	0	0	600 USD	52.53%	315'186.00	0.06 a)	
XS1110833123	6.0000 % BHRAIN 6 09/19/44 REGS	600	0	0	600 USD	85.78%	514'687.50	0.10 a)	
XS1117279882	6.1250 % JORDAN 6 1/8 01/29/26 REGS	600	200	0	800 USD	98.64%	789'120.00	0.15 a)	
XS1120709669	3.8750 % KAZAKS 3 7/8 10/14/24 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1120709826	4.8750 % KAZAKS 4 7/8 10/14/44 REGS	600	200	0	800 USD	98.88%	791'000.00	0.15 a)	
XS1125272143	5.6250 % CHITRA 5 5/8 11/03/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1141043296	4.4890 % TURKSK 4.489 11/25/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1151974877	6.6250 % ETHOPI 6 5/8 12/11/24 REGS	600	0	0	600 USD	77.22%	463'312.50	0.09 a)	
XS1175223699	5.7500 % TUNIS 5 3/4 01/30/25 REGS	600	0	0	600 USD	96.25%	577'494.00	0.11 a)	
XS1187065443	7.1250 % ESKOM 7 1/8 02/11/25 REGS	800	0	200	600 USD	99.88%	599'298.00	0.12 a)	
XS1196417569	6.2000 % LEBAN 6.2 02/26/25 GMTN	500	0	0	500 USD	6.25%	31'250.00	0.01 a)	
XS1196419854	6.6500 % LEBAN 6.65 02/26/30 GMTN	510	0	0	510 USD	6.25%	31'875.00	0.01 a)	
XS1196496688	6.9500 % SOIAZ 6.95 03/18/30	600	0	0	600 USD	105.49%	632'940.00	0.12 a)	
XS1196517434	6.3750 % IVYCS 6 3/8 03/03/28 REGS	450	0	0	450 USD	99.30%	446'859.00	0.09 a)	
XS1210507650	3.0940 % RAKS 3.094 03/31/25 EMTN	200	0	0	200 USD	98.61%	197'226.00	0.04 a)	
XS1245432742	5.8750 % EGYPT 5 7/8 06/11/25 REGS	800	200	200	800 USD	98.91%	791'250.00	0.15 a)	
XS1245960684	6.9500 % GABON 6.95 06/16/25 REGS	400	0	0	400 USD	93.41%	373'625.00	0.07 a)	
XS1263054519	5.1250 % KAZAKS 5 1/8 07/21/25 REGS	1'650	200	200	1'650 USD	100.05%	1'650'891.00	0.32 a)	
XS1263139856	6.5000 % KAZAKS 6 1/2 07/21/45 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	117.84%	1'178'437.50	0.23 a)	
XS1265180643	4.7500 % MINMET 4 3/4 07/30/25	200	0	0	200 USD	99.66%	199'312.50	0.04 a)	
XS1267081575	8.9700 % ZAMBIN 8.97 07/30/27 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1291170360	3.8000 % EXIMCH 3.8 09/16/25 REGS	0	200	0	200 USD	99.06%	198'126.00	0.04 a)	
XS1297557412	10.7500 % GHANA 10 3/4 10/14/30 REGS	600	0	0	600 USD	68.31%	409'878.00	0.08 a)	
XS1299811486	8.2500 % PKSTAN 8 1/4 09/30/25 REGS	400	0	0	400 USD	96.88%	387'500.00	0.08 a)	
XS1303925041	41.7531 % UKRAIN 7 3/4 09/01/26 REGS	850	0	0	850 USD	33.20%	282'200.00	0.05 a)	
XS1311099540	5.2500 % REPNAM 5 1/4 10/29/25 REGS	400	200	0	600 USD	98.69%	592'125.00	0.12 a)	
XS1313647841	6.2500 % LEBAN 6 1/4 11/04/24 GMTN	100	0	0	100 USD	6.25%	6'250.00	0.00 a)	
XS1313654623	7.0500 % LEBAN 7.05 11/02/35 GMTN	200	0	0	200 USD	6.25%	12'500.00	0.00 a)	
XS1313675974	6.6500 % LEBAN 6.65 11/03/28 GMTN	430	0	0	430 USD	6.25%	26'875.00	0.01 a)	
XS1318576086	9.5000 % ANGOL 9 1/2 11/12/25 REGS	500	200	0	700 USD	101.84%	712'906.25	0.14 a)	
XS1319820897	6.8750 % SGCAZE 6 7/8 03/24/26 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	101.69%	1'220'250.00	0.24 a)	
XS1324931895	7.0000 % BHRAIN 7 01/26/26 REGS	800	0	200	600 USD	101.75%	610'500.00	0.12 a)	
XS1395523779	2.8750 % EXIMCH 2 7/8 04/26/26	200	0	0	200 USD	97.88%	195'750.00	0.04 a)	
XS1396347566	6.6500 % LEBAN 6.65 04/22/24 8Y	200	0	0	200 USD	6.25%	12'500.00	0.00 a)	
XS1402929746	3.1250 % ADGB 3 1/8 05/03/26 REGS	600	200	200	600 USD	98.29%	589'728.00	0.11 a)	
XS1405766541	7.0000 % BHRAIN 7 10/12/28 REGS	850	0	0	850 USD	104.72%	890'109.38	0.17 a)	
XS1405770220	5.7500 % JORDAN 5 3/4 01/31/27 REGS	600	0	0	600 USD	97.31%	583'875.00	0.11 a)	
XS1405777589	4.7500 % OMAN 4 3/4 06/15/26 REGS	1'250	0	0	1'250 USD	99.15%	1'239'412.50	0.24 a)	
XS1405781854	4.6250 % QATAR 4 5/8 06/02/46 REGS	600	200	0	800 USD	96.06%	768'500.00	0.15 a)	
XS1405782159	3.2500 % QATAR 3 1/4 06/02/26 REGS	1'200	200	200	1'200 USD	98.13%	1'177'500.00	0.23 a)	
XS1422334448	3.0000 % SDBC 3 06/01/26 EMTN	200	0	0	200 USD	97.94%	195'876.00	0.04 a)	
XS1450332256	4.2000 % MINMET 4.2 07/27/26	200	0	0	200 USD	99.00%	198'000.00	0.04 a)	
XS1508675417	3.2500 % KSA 3 1/4 10/26/26 REGS	1'000	200	0	1'200 USD	97.66%	1'171'875.00	0.23 a)	
XS1508675508	4.5000 % KSA 4 1/2 10/26/46 REGS	1'450	200	200	1'450 USD	88.09%	1'277'359.38	0.25 a)	
XS1553212025	3.3750 % SDBC 3 3/8 01/24/27 EMTN	0	200	0	200 USD	98.72%	197'438.00	0.04 a)	
XS1553212371	4.0000 % SDBC 4 01/24/37 EMTN	200	0	0	200 USD	97.36%	194'720.00	0.04 a)	
XS1558078496	8.5000 % EGYPT 8 1/2 01/31/47 REGS	1'150	200	0	1'350 USD	77.34%	1'044'140.63	0.20 a)	
XS1558078736	7.5000 % EGYPT 7 1/2 01/31/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	97.81%	978'125.00	0.19 a)	
XS1566179039	7.8750 % NGERIA 7 7/8 02/16/32 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	89.00%	890'000.00	0.17 a)	
XS1575045338	3.3750 % EXIMCH 3 3/8 03/14/27	200	0	0	200 USD	98.42%	196'838.00	0.04 a)	
XS1575967218	5.3750 % OMAN 5 3/8 03/08/27 REGS	880	0	0	880 USD	100.75%	886'600.00	0.17 a)	
XS1575968026	6.5000 % OMAN 6 1/2 03/08/47 REGS	1'250	200	200	1'250 USD	105.63%	1'320'312.50	0.26 a)	
XS1577945824	5.2000 % MAZOOON 5.2 11/08/27 REGS	200	0	0	200 USD	99.88%	199'750.00	0.04 a)	
XS1577950311	7.3750 % JORDAN 7 3/8 10/10/47 REGS	600	0	0	600 USD	90.75%	544'500.00	0.11 a)	
XS1582346968	3.5000 % KUWIB 3 1/2 03/20/27 REGS	3'100	200	200	3'100 USD	97.84%	3'033'156.25	0.59 a)	
XS1586230051	6.8500 % LEBAN 6.85 03/23/27 10Y	620	0	0	620 USD	6.25%	38'750.00	0.01 a)	
XS1586230309	7.2500 % LEBAN 7 1/4 03/23/37 20Y	200	0	0	200 USD	6.25%	12'500.00	0.00 a)	
XS1586230481	7.0000 % LEBAN 7 03/23/32 15YR	480	0	0	480 USD	6.25%	30'000.00	0.01 a)	
XS1599284202	3.6280 % KSA 3.628 04/20/27 REGS	1'000	200	200	1'000 USD	98.28%	982'812.50	0.19 a)	
XS1619155564	6.2500 % SENEGL 6 1/4 05/23/33 REGS	800	0	0	800 USD	86.78%	694'250.00	0.14 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.
X51631415400	6.1250 % IVYCT 6 1/8 06/15/33 REGS	850	200	200	850 USD	91.41%	776'953.13	0.15	a)
X51644429935	4.1250 % HAOHUA 4 1/8 07/19/27	200	0	0	200 USD	98.31%	196'625.00	0.04	a)
X51675855073	5.2500 % BHRAIN 5 1/4 03/20/25 REGS	600	0	0	600 USD	99.49%	596'934.00	0.12	a)
X51675862012	6.7500 % BHRAIN 6 3/4 09/20/29 REGS	600	200	0	800 USD	103.50%	828'000.00	0.16	a)
X51675862103	7.5000 % BHRAIN 7 1/2 09/20/47 REGS	600	0	0	600 USD	100.03%	600'187.50	0.12	a)
X51676401414	7.1250 % TAJIKI 7 1/8 09/14/27 REGS	400	0	0	400 USD	96.72%	386'875.00	0.08	a)
X51678623734	3.5000 % AZERBJ 3 1/2 09/01/32 REGS	700	0	0	700 USD	89.13%	623'875.00	0.12	a)
X51682544157	4.3750 % KZTGKZ 4 3/8 09/26/27 REGS	400	0	0	400 USD	96.09%	384'376.00	0.07	a)
X51694217495	3.6250 % KSA 3 5/8 03/04/28 REGS	1'000	400	200	1'200 USD	97.53%	1'170'375.00	0.23	a)
X51694218469	4.6250 % KSA 4 5/8 10/04/47 REGS	800	200	0	1'000 USD	89.59%	895'937.50	0.17	a)
X51696892295	3.1250 % ADGB 3 1/8 10/11/27 REGS	1'050	200	200	1'050 USD	96.88%	1'017'187.50	0.20	a)
X51696899035	4.1250 % ADGB 4 1/8 10/11/47 REGS	600	200	0	800 USD	88.75%	710'000.00	0.14	a)
X51706605281	2.6250 % CHINA 2 5/8 11/02/27	200	0	0	200 USD	96.84%	193'688.00	0.04	a)
X51709529520	3.6500 % ADNOUH 3.65 11/02/29 REGS	200	0	0	200 USD	96.63%	193'250.00	0.04	a)
X51709535097	4.6000 % ADNOUH 4.6 11/02/47 REGS	600	200	200	600 USD	92.78%	556'687.50	0.11	a)
X51717011982	6.5000 % NGERIA 6 1/2 11/28/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	93.13%	931'250.00	0.18	a)
X51717013095	7.6250 % NGERIA 7 5/8 11/28/47 REGS	1'000	200	200	1'000 USD	75.44%	754'375.00	0.15	a)
X51717764143	4.0000 % EXIMCH 4 11/28/47 EMTN	200	0	0	200 USD	89.72%	179'438.00	0.03	a)
X51717770975	3.2500 % EXIMCH 3 1/4 11/28/27 EMTN	0	200	0	200 USD	97.70%	195'400.00	0.04	a)
X51729875598	6.8750 % PKSTAN 6 7/8 12/05/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	86.75%	867'500.00	0.17	a)
X51750113661	5.6250 % OMAN 5 5/8 01/17/28 REGS	1'400	200	200	1'400 USD	102.09%	1'429'312.50	0.28	a)
X51750114396	6.7500 % OMAN 6 3/4 01/17/48 REGS	1'450	200	0	1'650 USD	108.47%	1'789'734.38	0.35	a)
X51775617464	7.9030 % EGYPT 7.903 02/21/48 REGS	800	0	0	800 USD	73.63%	589'000.00	0.11	a)
X51775618439	6.5880 % EGYPT 6.588 02/21/28 REGS	600	200	0	800 USD	93.16%	745'250.00	0.14	a)
X51777972511	7.1430 % NGERIA 7.143 02/23/30 REGS	800	0	0	800 USD	90.47%	723'750.00	0.14	a)
X51777972941	7.6960 % NGERIA 7.696 02/23/38 REGS	800	0	0	800 USD	80.13%	641'000.00	0.12	a)
X51781710543	7.2500 % KENINT 7 1/4 02/28/28 REGS	600	0	0	600 USD	91.75%	550'500.00	0.11	a)
X51781710626	8.2500 % KENINT 8 1/4 02/28/48 REGS	600	0	0	600 USD	79.09%	474'562.50	0.09	a)
X51788513734	5.1250 % HAOHUA 5 1/8 03/14/28	600	200	200	600 USD	100.91%	605'484.00	0.12	a)
X51788514039	4.8750 % HAOHUA 4 7/8 03/14/25	200	0	0	200 USD	99.82%	199'646.00	0.04	a)
X51790134362	6.7500 % SENEGL 6 3/4 03/13/48 REGS	600	0	0	600 USD	74.38%	446'250.00	0.09	a)
X51791326991	4.2260 % SHARSK 4.226 03/14/28 EMTN	200	200	0	400 USD	97.31%	389'252.00	0.08	a)
X51791937441	4.0000 % KSA 4 04/17/25 REGS	800	0	0	800 USD	99.50%	796'000.00	0.15	a)
X51791939066	4.5000 % KSA 4 1/2 04/17/30 REGS	600	200	0	800 USD	99.75%	798'000.00	0.16	a)
X51791939736	5.0000 % KSA 5 04/17/49 REGS	600	200	0	800 USD	94.38%	755'048.00	0.15	a)
X51799523276	5.9320 % OMANGS 5.932 10/31/25 REGS	800	0	0	800 USD	101.19%	809'500.00	0.16	a)
X51802362951	6.8750 % BHRAIN 6 7/8 10/05/25 REGS	600	0	0	600 USD	101.50%	609'000.00	0.12	a)
X51807174393	4.5000 % QATAR 4 1/2 04/23/28 REGS	900	200	0	1'100 USD	101.34%	1'114'781.25	0.22	a)
X51807174559	5.1030 % QATAR 5.103 04/23/48 REGS	1'850	200	0	2'050 USD	101.88%	2'088'437.50	0.41	a)
X51819680288	8.2500 % ANGOL 8 1/4 05/09/28 REGS	1'200	200	200	1'200 USD	95.59%	1'147'125.00	0.22	a)
X51819680528	9.3750 % ANGOL 9 3/8 05/08/48 REGS	1'250	200	200	1'250 USD	86.00%	1'075'000.00	0.21	a)
X51821416234	7.6250 % GHANA 7 5/8 05/16/29 REGS	600	200	0	800 USD	51.81%	414'500.00	0.08	a)
X51821416408	8.6270 % GHANA 8.627 06/16/49 REGS	450	200	0	650 USD	51.81%	336'781.25	0.07	a)
X51837994794	5.1250 % ROMANI 5 1/8 06/15/48 REGS	800	150	100	850 USD	85.25%	724'625.00	0.14	a)
X51843435766	8.0000 % KENINT 8 05/22/32 REGS	600	300	0	900 USD	88.84%	799'596.00	0.16	a)
X51843435840	7.0000 % KENINT 7 05/22/27 REGS	600	0	0	600 USD	95.81%	574'875.00	0.11	a)
X51864522757	8.4500 % ESKOM 8.45 08/10/28 REGS	200	0	0	200 USD	103.69%	207'386.00	0.04	a)
X51864523300	6.3500 % ESKOM 6.35 08/10/28 REGS	600	0	0	600 USD	100.03%	600'186.00	0.12	a)
X51881581968	4.3030 % KSA 4.303 01/19/29 REGS	400	0	0	400 USD	99.72%	398'875.00	0.08	a)
X51883879006	5.6250 % DPWDU 5 5/8 09/25/48 REGS	200	0	0	200 USD	99.56%	199'125.00	0.04	a)
X51883963990	4.8480 % DPWDU 4.848 09/26/28 REGS	400	0	0	400 USD	100.78%	403'125.00	0.08	a)
X51891574441	3.5000 % CHINA 3 1/2 10/19/28	200	0	0	200 USD	99.16%	198'312.00	0.04	a)
X51891577030	4.0000 % CHINA 4 10/19/48	200	0	0	200 USD	95.43%	190'858.00	0.04	a)
X51903485800	8.3750 % OILGAS 8 3/8 11/07/28 REGS	200	0	0	200 USD	108.31%	216'626.00	0.04	a)
X51904648570	4.5000 % MUBAUH 4 1/2 11/07/28 REGS	200	0	0	200 USD	100.01%	200'018.00	0.04	a)
X51910826996	7.6250 % NGERIA 7 5/8 11/21/25 REGS	650	200	0	850 USD	100.19%	851'593.75	0.17	a)
X51910827887	8.7470 % NGERIA 8.747 01/21/31 REGS	650	0	0	650 USD	95.44%	620'343.75	0.12	a)
X51910828182	9.2480 % NGERIA 9.248 01/21/49 REGS	400	200	0	600 USD	89.38%	536'250.00	0.10	a)
X51936302865	4.3750 % KSA 4 3/8 04/16/29 REGS	800	0	0	800 USD	99.81%	798'500.00	0.16	a)
X51936302949	5.2500 % KSA 5 1/4 01/16/50 REGS	800	200	200	800 USD	97.97%	783'750.00	0.15	a)
X51944412664	4.8750 % OMAN 4 7/8 02/01/25 REGS	600	0	200	400 USD	99.58%	398'328.00	0.08	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.
XS1944412748	6.0000 % OMAN 6 08/01/29 REGS	1'250	0	0	1'250 USD	104.10%	1'301'250.00	0.25	a)
XS1953057061	7.6000 % EGYPT 7.6003 03/01/29 REGS	800	600	400	1'000 USD	94.06%	940'625.00	0.18	a)
XS1953057491	8.7002 % EGYPT 8.7002 03/01/49 REGS	850	400	400	850 USD	78.19%	664'589.50	0.13	a)
XS1953915136	5.3750 % UZBEK 5 3/8 02/20/29 REGS	400	0	0	400 USD	95.38%	381'500.00	0.07	a)
XS1959337582	4.0000 % QATAR 4 03/14/29 REGS	1'250	200	0	1'450 USD	99.53%	1'443'203.13	0.28	a)
XS1959337749	4.8170 % QATAR 4.817 03/14/49 REGS	2'080	600	600	2'080 USD	98.28%	2'044'250.00	0.40	a)
XS1968714110	7.8750 % GHANA 7 7/8 03/26/27 REGS	600	0	0	600 USD	52.00%	312'000.00	0.06	a)
XS1968714540	8.1250 % GHANA 8 1/8 03/26/32 REGS	900	200	300	800 USD	52.53%	420'250.00	0.08	a)
XS1968714623	8.9500 % GHANA 8.95 03/26/51 REGS	650	0	0	650 USD	52.72%	342'673.50	0.07	a)
XS1969593356	3.8540 % SHARSK 3.854 04/03/26 EMTN	200	0	0	200 USD	97.72%	195'436.00	0.04	a)
XS1989705063	3.7500 % SDIC 3 3/4 05/21/29 EMTN	200	0	0	200 USD	97.78%	195'562.50	0.04	a)
XS2010026305	5.2500 % REPHUN 5 1/4 06/16/29 REGS	1'150	0	0	1'150 USD	100.98%	1'161'212.50	0.23	a)
XS2010026487	5.5000 % REPHUN 5 1/2 06/16/34 REGS	800	0	0	800 USD	101.22%	809'750.00	0.16	a)
XS2010026727	4.7500 % UNGUZB 4 3/4 11/16/28 REGS	400	0	0	400 USD	86.31%	345'250.00	0.07	a)
XS2010027709	4.3140 % ESKOM 4.314 07/23/27	200	200	0	400 USD	95.56%	382'252.00	0.07	a)
XS2010028939	3.6000 % ARMEN 3.6 02/02/31 REGS	550	0	0	550 USD	84.06%	462'343.75	0.09	a)
XS2010043904	3.9500 % ARMEN 3.95 09/26/29 REGS	200	200	0	400 USD	88.72%	354'875.00	0.07	a)
XS2011969735	3.8750 % HAOHUA 3 7/8 06/19/29	200	0	0	200 USD	95.84%	191'687.50	0.04	a)
XS2026710553	3.8750 % DPWDU 3 7/8 07/18/29 EMTN	200	0	0	200 USD	96.50%	192'992.00	0.04	a)
XS2051055908	4.1000 % CHALUM 4.1 PERP	200	0	0	200 USD	99.95%	199'890.00	0.04	a)
XS2051203862	9.0000 % MOZAM 9 09/15/31 REGS	600	0	0	600 USD	84.09%	504'564.00	0.10	a)
XS2056707420	3.7495 % DPWDU 3.7495 01/30/30 REGS	200	0	0	200 USD	95.47%	190'937.50	0.04	a)
XS2056719359	4.7000 % DPWDU 4.7 09/30/49 REGS	200	0	0	200 USD	87.84%	175'687.50	0.03	a)
XS2057865979	2.5000 % ADGB 2 1/2 09/30/29 REGS	800	200	200	800 USD	92.91%	743'250.00	0.14	a)
XS2057866191	3.1250 % ADGB 3 1/8 09/30/49 REGS	800	200	0	1'000 USD	73.50%	735'000.00	0.14	a)
XS2058943734	4.5000 % BHRAIN 4 1/2 03/30/27 REGS	600	0	0	600 USD	97.41%	584'437.50	0.11	a)
XS2058948451	5.6250 % BHRAIN 5 5/8 09/30/31 REGS	650	0	0	650 USD	97.06%	630'906.25	0.12	a)
XS2067187810	3.2340 % SHARSK 3.234 10/23/29	200	0	0	200 USD	91.36%	182'718.00	0.04	a)
XS2072816114	2.9690 % KSA 2.969 10/29/29 REGS	600	200	250	550 USD	93.34%	513'390.63	0.10	a)
XS2075921887	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 11/07/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2075923313	2.8750 % MUBAUH 2 7/8 11/07/29 REGS	200	0	0	200 USD	93.01%	186'018.00	0.04	a)
XS2075924048	3.7000 % MUBAUH 3.7 11/07/49 REGS	400	0	0	400 USD	79.94%	319'750.00	0.06	a)
XS2079842642	7.0529 % EGYPT 7.0529 01/15/32 REGS	600	0	0	600 USD	83.53%	501'187.50	0.10	a)
XS2079846635	8.1500 % EGYPT 8.15 11/20/59 REGS	200	0	0	200 USD	73.38%	146'750.00	0.03	a)
XS2080205797	2.6000 % HUANEN 2.6 12/10/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2080206092	3.0000 % HUANEN 3 12/10/29	200	0	0	200 USD	94.06%	188'128.00	0.04	a)
XS2083302419	8.0000 % ANGOL 8 11/26/29 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	91.81%	1'009'937.50	0.20	a)
XS2083302500	9.1250 % ANGOL 9 1/8 11/26/49 REGS	800	0	0	800 USD	84.16%	673'250.00	0.13	a)
XS2084424493	1.9500 % CHINA 1.95 12/03/24	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2084425110	2.1250 % CHINA 2 1/8 12/03/29	600	0	0	600 USD	92.72%	556'314.00	0.11	a)
XS2084425623	2.7500 % CHINA 2 3/4 12/03/39	0	200	0	200 USD	84.02%	168'038.00	0.03	a)
XS2103157991	4.1000 % MUMTAK 4.1 01/21/27	200	200	0	400 USD	96.09%	384'376.00	0.07	a)
XS2109766126	2.5000 % KSA 2 1/2 02/03/27 REGS	200	0	0	200 USD	95.78%	191'562.50	0.04	a)
XS2109766472	2.7500 % KSA 2 3/4 02/03/32 REGS	200	0	0	200 USD	88.69%	177'375.00	0.03	a)
XS2109770151	3.7500 % KSA 3 3/4 01/21/55 REGS	600	0	0	600 USD	74.59%	447'562.50	0.09	a)
XS2113615228	6.6250 % GABON 6 5/8 02/06/31 REGS	600	0	0	600 USD	76.41%	458'437.50	0.09	a)
XS2115122538	6.3750 % GHANA 6 3/8 02/11/27 REGS	700	0	0	700 USD	51.66%	361'593.75	0.07	a)
XS2115141751	7.8750 % GHANA 7 7/8 02/11/35 REGS	600	0	0	600 USD	52.56%	315'378.00	0.06	a)
XS2115147287	8.7500 % GHANA 8 3/4 03/11/61 REGS	400	0	0	400 USD	52.72%	210'876.00	0.04	a)
XS2116905691	2.1250 % JIANYI 2 1/8 08/27/30	200	0	0	200 USD	88.13%	176'250.00	0.03	a)
XS2125308085	2.5000 % ADGB 2 1/2 04/16/25 REGS	600	0	0	600 USD	98.48%	590'874.00	0.11	a)
XS2125308168	3.1250 % ADGB 3 1/8 04/16/30 REGS	600	200	0	800 USD	95.20%	761'576.00	0.15	a)
XS2125308242	3.8750 % ADGB 3 7/8 04/16/50 REGS	1'000	200	200	1'000 USD	84.19%	841'880.00	0.16	a)
XS2140041786	3.1250 % CHITRA 3 1/8 04/23/30	200	0	0	200 USD	93.81%	187'625.00	0.04	a)
XS2152902479	1.6250 % CHGRID 1 5/8 08/05/30 EMTN	200	200	0	400 USD	86.76%	347'052.00	0.07	a)
XS2155352151	3.4000 % QATAR 3.4 04/16/25 REGS	600	0	0	600 USD	99.13%	594'750.00	0.12	a)
XS2155352664	3.7500 % QATAR 3 3/4 04/16/30 REGS	900	200	0	1'100 USD	98.28%	1'081'093.75	0.21	a)
XS2155352748	4.4000 % QATAR 4.4 04/16/50 REGS	1'600	200	0	1'800 USD	92.00%	1'656'000.00	0.32	a)
XS2158697255	6.0000 % DPWDU 6 PERP	200	0	0	200 USD	99.55%	199'100.00	0.04	a)
XS2159975619	2.9000 % KSA 2.9 10/22/25 REGS	400	200	0	600 USD	98.16%	588'937.50	0.11	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.
XS2159975700	3.2500 % KSA 3 1/4 10/22/30 REGS	300	0	0	300 USD	93.22%	279'672.00	0.05	a)
XS2159975882	4.5000 % KSA 4 1/2 04/22/60 REGS	600	0	0	600 USD	85.16%	510'937.50	0.10	a)
XS2172964715	6.2500 % BHRAIN 6 1/4 11/14/24 REGS	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2172965282	7.3750 % BHRAIN 7 3/8 05/14/30 REGS	600	0	0	600 USD	106.53%	639'187.50	0.12	a)
XS2175968580	3.9500 % MUBAUH 3.95 05/21/50 GMTN	400	0	0	400 USD	82.84%	331'375.00	0.06	a)
XS2176018609	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 05/21/26 GMTN	200	0	0	200 USD	96.09%	192'187.50	0.04	a)
XS2176021223	2.8750 % MUBAUH 2 7/8 05/21/30 GMTN	200	0	0	200 USD	92.16%	184'312.50	0.04	a)
XS2176897754	7.6250 % EGYPT 7 5/8 05/29/32 REGS	800	200	0	1'000 USD	85.63%	856'250.00	0.17	a)
XS2176899701	8.8750 % EGYPT 8 7/8 05/29/50 REGS	1'000	200	0	1'200 USD	79.47%	953'625.00	0.19	a)
XS2179917906	1.3500 % CNPCCH 1.35 06/23/25	200	0	0	200 USD	97.16%	194'312.50	0.04	a)
XS2179918037	2.0000 % CNPCCH 2 06/23/30	0	200	0	200 USD	88.70%	177'396.00	0.03	a)
XS2182820329	2.9420 % SHARK 2.942 06/10/27	200	0	0	200 USD	94.03%	188'062.00	0.04	a)
XS2184856859	3.3750 % HUADIA 3 3/8 PERP	200	0	0	200 USD	98.56%	197'126.00	0.04	a)
XS2199272662	5.8500 % JORDAN 5.85 07/07/30 REGS	830	0	0	830 USD	94.38%	783'312.50	0.15	a)
XS2199321113	4.9500 % JORDAN 4.95 07/07/25 REGS	400	0	0	400 USD	98.22%	392'875.00	0.08	a)
XS2201851172	3.0000 % ROMANI 3 02/14/31 REGS	780	100	0	880 USD	85.98%	756'597.60	0.15	a)
XS2201851685	4.0000 % ROMANI 4 02/14/51 REGS	1'260	350	160	1'450 USD	71.41%	1'035'503.00	0.20	a)
XS2207514063	4.0000 % SHJGOV 4 07/28/50 REGS	200	0	0	200 USD	68.13%	136'250.00	0.03	a)
XS2208275854	1.6250 % POWINV 1 5/8 07/27/25 EMTN	200	0	0	200 USD	97.16%	194'312.50	0.04	a)
XS2214237807	6.9000 % ECUA 6.9 07/31/30 REGS	2'227	150	0	2'377 USD	71.15%	1'691'520.10	0.33	a)
XS2214238441	5.5000 % ECUA 5 1/2 07/31/35 REGS	4'768	250	150	4'868 USD	55.25%	2'689'652.88	0.52	a)
XS2214239175	5.0000 % ECUA 5 07/31/40 REGS	1'890	150	0	2'040 USD	50.55%	1'031'198.77	0.20	a)
XS2214239506	0.0000 % ECUA 0 07/31/30 REGS	512	150	0	662 USD	54.15%	358'630.04	0.07	a)
XS2225210330	2.7000 % ADGB 2.7 09/02/70 REGS	400	0	0	400 USD	62.41%	249'625.00	0.05	a)
XS2225210413	1.7000 % ADGB 1.7 03/02/31 REGS	400	0	0	400 USD	86.14%	344'572.00	0.07	a)
XS2226808082	2.0000 % HAOHUA 2 09/22/25	200	0	0	200 USD	96.75%	193'506.00	0.04	a)
XS2226808165	3.0000 % HAOHUA 3 09/22/30	200	0	0	200 USD	90.38%	180'750.00	0.04	a)
XS2226916216	5.4500 % BHRAIN 5.45 09/16/32 REGS	600	0	0	600 USD	94.97%	569'812.50	0.11	a)
XS2226917701	3.9500 % BHRAIN 3.95 09/16/27 REGS	600	0	0	600 USD	95.59%	573'562.50	0.11	a)
XS2226973522	3.9000 % DUGB 3.9 09/09/50 EMTN	200	200	0	400 USD	76.95%	307'800.00	0.06	a)
XS2234859101	6.7500 % OMAN 6 3/4 10/28/27 REGS	800	200	200	800 USD	105.00%	840'000.00	0.16	a)
XS2234859283	7.3750 % OMAN 7 3/8 10/28/32 REGS	600	0	0	600 USD	113.75%	682'500.00	0.13	a)
XS2237806281	2.2000 % COFCHK 2.2 10/21/30	200	0	0	200 USD	88.09%	176'187.50	0.03	a)
XS2237806364	3.1000 % COFCHK 3.1 PERP	200	0	0	200 USD	97.72%	195'437.50	0.04	a)
XS2241075014	5.2500 % EGYPT 5 1/4 10/06/25 REGS	400	0	0	400 USD	97.41%	389'625.00	0.08	a)
XS2244843210	3.0800 % HUANEN 3.08 PERP	200	0	0	200 USD	97.31%	194'626.00	0.04	a)
XS2245508044	2.3940 % UNITYL 2.394 11/03/25 EMTN	200	0	0	200 USD	96.94%	193'876.00	0.04	a)
XS2247216174	1.0000 % SDBC 1 10/27/25 EMTN	200	0	0	200 USD	96.00%	191'996.00	0.04	a)
XS2247216257	1.6250 % SDBC 1 5/8 10/27/30 EMTN	200	0	0	200 USD	86.88%	173'750.00	0.03	a)
XS2247703163	2.7000 % HUANEN 2.7 01/20/31	200	0	0	200 USD	90.34%	180'688.00	0.04	a)
XS2248081601	3.2230 % INVCOR 3.223 04/28/26	0	200	0	200 USD	96.88%	193'750.00	0.04	a)
XS2248458395	5.1250 % OMAOIL 5 1/8 05/06/28 REGS	450	0	0	450 USD	99.66%	448'453.13	0.09	a)
XS2249462016	1.6250 % SINOCH 1 5/8 10/29/25 EMTN	200	0	0	200 USD	96.06%	192'124.00	0.04	a)
XS2262220143	3.7500 % DUBAEE 3 3/4 02/15/26 REGS	200	0	0	200 USD	98.03%	196'062.50	0.04	a)
XS2263765856	3.7000 % UZBEK 3.7 11/25/30 REGS	400	0	0	400 USD	85.06%	340'250.00	0.07	a)
XS2264555744	2.1250 % SERBIA 2 1/8 12/01/30 REGS	600	200	0	800 USD	82.38%	659'000.00	0.13	a)
XS2269194499	3.0800 % CHPWCN 3.08 PERP	200	0	0	200 USD	97.00%	194'000.00	0.04	a)
XS2270576619	2.3750 % MOROC 2 3/8 12/15/27 REGS	500	0	0	500 USD	91.97%	459'843.75	0.09	a)
XS2270576965	3.0000 % MOROC 3 12/15/32 REGS	600	0	0	600 USD	84.42%	506'496.00	0.10	a)
XS2270577344	4.0000 % MOROC 4 12/15/50 REGS	700	200	0	900 USD	72.72%	654'468.75	0.13	a)
XS2274089288	5.3750 % TCZIRA 5 3/8 03/02/26 REGS	200	0	0	200 USD	99.09%	198'187.50	0.04	a)
XS2280637039	3.7500 % MEX 3 3/4 04/19/2071	600	0	0	600 USD	62.91%	377'437.50	0.07	a)
XS2286303495	3.3750 % DUBAEE 3 3/8 03/20/28 REGS	200	0	0	200 USD	94.32%	188'632.00	0.04	a)
XS2288905370	6.2500 % OMAN 6 1/4 01/25/31 REGS	800	200	0	1'000 USD	106.28%	1'062'790.00	0.21	a)
XS2288906857	7.0000 % OMAN 7 01/25/51 REGS	600	200	200	600 USD	111.72%	670'312.50	0.13	a)
XS2290956924	4.2500 % BHRAIN 4 1/4 01/25/28 REGS	400	200	200	400 USD	95.50%	382'000.00	0.07	a)
XS2290957146	5.2500 % BHRAIN 5 1/4 01/25/33 REGS	600	200	200	600 USD	92.38%	554'250.00	0.11	a)
XS2290957732	6.2500 % BHRAIN 6 1/4 01/25/51 REGS	400	0	0	400 USD	86.47%	345'875.00	0.07	a)
XS2294322818	2.2500 % KSA 2 1/4 02/02/33 REGS	600	0	0	600 USD	82.81%	496'875.00	0.10	a)
XS2294323386	3.4500 % KSA 3.45 02/02/61 REGS	320	200	0	520 USD	69.38%	360'750.00	0.07	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.
XS2297220423	3.8750 % EGYPT 3 7/8 02/16/26 REGS	400	0	0	400 USD	94.28%	377'125.00	0.07	a)
XS2297221405	7.5000 % EGYPT 7 1/2 02/16/61 REGS	850	0	0	850 USD	69.03%	586'765.63	0.11	a)
XS2297226545	5.8750 % EGYPT 5 7/8 02/16/31 REGS	700	0	0	700 USD	80.88%	566'125.00	0.11	a)
XS2302929810	3.6250 % SHJGOV 3 5/8 03/10/33 REGS	200	0	0	200 USD	86.75%	173'500.00	0.03	a)
XS2302929901	4.3750 % SHJGOV 4 3/8 03/10/51 REGS	200	0	0	200 USD	72.28%	144'562.50	0.03	a)
XS2322319398	6.0000 % PKSTAN 6 04/08/26 REGS	740	200	0	940 USD	91.75%	862'450.00	0.17	a)
XS2322319638	7.3750 % PKSTAN 7 3/8 04/08/31 REGS	1'090	200	300	990 USD	79.63%	788'287.50	0.15	a)
XS2322321964	8.8750 % PKSTAN 8 7/8 04/08/51 REGS	420	200	0	620 USD	74.88%	464'225.00	0.09	a)
XS2324826994	3.4000 % MUBAUH 3.4 06/07/51 EMTN	200	0	0	200 USD	75.25%	150'500.00	0.03	a)
XS2325742166	0.0000 % GHANA 0 04/07/25 REGS	200	0	0	200 USD	42.88%	85'750.00	0.02	a)
XS2325747397	8.6250 % GHANA 8 5/8 04/07/34 REGS	620	0	0	620 USD	52.53%	325'693.75	0.06	a)
XS2325747637	8.8750 % GHANA 8 7/8 05/07/42 REGS	400	0	0	400 USD	52.34%	209'376.00	0.04	a)
XS2325748106	7.7500 % GHANA 7 3/4 04/07/29 REGS	500	0	0	500 USD	52.38%	261'875.00	0.05	a)
XS2327851874	3.5000 % CHILE 3 1/2 04/15/53	400	0	0	400 USD	74.45%	297'800.00	0.06	a)
XS2328888149	5.2500 % OILGAS 5 1/4 04/08/29 REGS	450	0	0	450 USD	97.94%	440'718.75	0.09	a)
XS2332876106	5.7500 % EXCRTU 5 3/4 07/06/26 REGS	200	0	0	200 USD	98.97%	197'937.50	0.04	a)
XS2334109423	2.7500 % GEORG 2 3/4 04/22/26 REGS	200	0	0	200 USD	93.97%	187'937.50	0.04	a)
XS2340059794	2.1250 % CHALUM 2 1/8 06/03/26	200	0	0	200 USD	95.60%	191'208.00	0.04	a)
XS2340149439	4.0000 % GRAIL 4 06/17/28 REGS	400	0	0	400 USD	89.81%	359'252.00	0.07	a)
XS2348236980	1.6250 % ADGB 1 5/8 06/02/28 REGS	400	0	0	400 USD	91.30%	365'200.00	0.07	a)
XS2348591707	7.5000 % PAKWNP 7 1/2 06/04/31	400	0	0	400 USD	72.91%	291'624.00	0.06	a)
XS2348658035	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 06/03/31 GMTN	200	0	0	200 USD	88.44%	176'875.00	0.03	a)
XS2351109116	5.1250 % TURKSK 5 1/8 06/22/26 REGS	600	0	0	600 USD	98.45%	590'700.00	0.11	a)
XS2351310482	4.8750 % OMANGS 4 7/8 06/15/30 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.41%	994'062.50	0.19	a)
XS2352309681	1.6390 % EMDEBK 1.639 06/15/26 EMTN	200	0	0	200 USD	94.34%	188'687.50	0.04	a)
XS2354781614	6.3000 % KENINT 6.3 01/23/34 REGS	600	0	0	600 USD	76.75%	460'500.00	0.09	a)
XS2357493860	1.3750 % QPETRO 1 3/8 09/12/26 REGS	400	200	0	600 USD	94.34%	566'064.00	0.11	a)
XS2357494322	2.2500 % QPETRO 2 1/4 07/12/31 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	87.25%	1'047'000.00	0.20	a)
XS2357494751	3.3000 % QPETRO 3.3 07/12/51 REGS	1'400	200	200	1'400 USD	74.23%	1'039'150.00	0.20	a)
XS2358712896	3.2000 % SHARSK 3.2 07/13/31	200	0	0	200 USD	88.13%	176'266.00	0.03	a)
XS2358735830	1.1250 % CHGRID 1 1/8 09/08/26	0	200	0	200 USD	93.67%	187'338.00	0.04	a)
XS2359548935	3.1250 % QPETRO 3 1/8 07/12/41 REGS	1'150	0	0	1'150 USD	79.00%	908'500.00	0.18	a)
XS2365195978	3.9000 % UZBEK 3.9 10/19/31 REGS	450	0	0	450 USD	84.56%	380'531.25	0.07	a)
XS2373051320	5.5000 % RWANDA 5 1/2 08/09/31 REGS	300	200	0	500 USD	80.34%	401'718.75	0.08	a)
XS2384698994	6.1250 % NGERIA 6 1/8 09/28/28 REGS	750	0	0	750 USD	90.00%	675'000.00	0.13	a)
XS2384701020	7.3750 % NGERIA 7 3/8 09/28/33 REGS	1'100	200	200	1'100 USD	83.63%	919'875.00	0.18	a)
XS2384704800	8.2500 % NGERIA 8 1/4 09/28/51 REGS	850	0	0	850 USD	78.88%	670'437.50	0.13	a)
XS2386638733	1.8750 % ADGB 1 7/8 09/15/31 REGS	400	0	0	400 USD	86.03%	344'116.00	0.07	a)
XS2386638816	3.0000 % ADGB 3 09/15/51 REGS	200	0	0	200 USD	71.31%	142'626.00	0.03	a)
XS2387357341	1.5000 % SINOCH 1 1/2 09/23/26 EMTN	200	0	0	200 USD	93.56%	187'125.00	0.04	a)
XS2387368975	2.3750 % SINOCH 2 3/8 09/23/31 EMTN	0	200	0	200 USD	84.37%	168'742.00	0.03	a)
XS2388586401	2.1250 % REPHUN 2 1/8 09/22/31 REGS	1'400	400	200	1'600 USD	82.35%	1'317'600.00	0.26	a)
XS2388586583	3.1250 % REPHUN 3 1/8 09/21/51 REGS	1'450	200	200	1'450 USD	66.13%	958'812.50	0.19	a)
XS2391394348	5.8000 % EGYPT 5.8 09/30/27 REGS	600	0	0	600 USD	91.84%	551'062.50	0.11	a)
XS2391395154	7.3000 % EGYPT 7.3 09/30/33 REGS	600	200	200	600 USD	82.00%	492'000.00	0.10	a)
XS2391398174	8.7500 % EGYPT 8 3/4 09/30/51 REGS	400	0	0	400 USD	78.38%	313'500.00	0.06	a)
XS2395576437	9.3750 % EXCRTU 9 3/8 01/31/26 REGS	200	0	0	200 USD	104.63%	209'250.00	0.04	a)
XS2397053757	2.0000 % UAE 2 10/19/31 REGS	200	0	0	200 USD	86.02%	172'036.00	0.03	a)
XS2397055703	3.2500 % UAE 3 1/4 10/19/61 REGS	500	0	0	500 USD	71.75%	358'750.00	0.07	a)
XS2397083820	2.8750 % UAE 2 7/8 10/19/41 REGS	200	0	0	200 USD	76.81%	153'625.00	0.03	a)
XS2399149694	2.0000 % SAMRUK 2 10/28/26 REGS	400	0	0	400 USD	92.94%	371'752.00	0.07	a)
XS2407752711	7.0000 % GABON 7 11/24/31 REGS	350	0	0	350 USD	76.25%	266'875.00	0.05	a)
XS2408001365	2.2500 % SINOCH 2 1/4 11/24/26 EMTN	200	0	0	200 USD	94.38%	188'750.00	0.04	a)
XS2408002769	3.8750 % BHRAIN 3 7/8 05/18/29 REGS	600	0	0	600 USD	93.25%	559'500.00	0.11	a)
XS2408003064	5.6250 % BHRAIN 5 5/8 05/18/34 REGS	600	0	0	600 USD	93.75%	562'500.00	0.11	a)
XS2408477797	2.2500 % KSA 2 1/4 05/17/31 REGS	400	0	0	400 USD	86.78%	347'125.00	0.07	a)
XS2408613136	3.2500 % KSA 3 1/4 11/17/51 REGS	200	0	0	200 USD	69.89%	139'780.00	0.03	a)
XS2419405274	7.9500 % PKSTAN 7.95 01/31/29 REGS	500	0	0	500 USD	89.56%	447'815.00	0.09	a)
XS2434699968	2.9500 % CHITRA 2.95 03/01/27	0	200	0	200 USD	96.71%	193'426.00	0.04	a)
XS2434895988	3.0000 % ROMANI 3 02/27/27 REGS	950	160	100	1'010 USD	94.80%	957'480.00	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 USD	in % 7)	Kat.
XS2434896010	3.6250 % ROMANI 3 5/8 03/27/32 REGS	740	60	80	720 USD	87.88%	632'700.00	0.12	a)
XS2435557959	2.9500 % CHALUM 2.95 02/24/27	0	200	0	200 USD	95.97%	191'937.50	0.04	a)
XS2441287773	7.2500 % TURKSK 7 1/4 02/24/27 REGS	700	0	0	700 USD	102.59%	718'156.25	0.14	a)
XS2445169985	8.3750 % NGERIA 8 3/8 03/24/29 REGS	900	200	200	900 USD	96.78%	871'031.25	0.17	a)
XS2446175577	8.7500 % ANGOL 8 3/4 04/14/32 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	90.81%	1'089'756.00	0.21	a)
XS2455411558	4.2500 % CHPWCN 4 1/4 PERP	200	0	0	200 USD	97.72%	195'438.00	0.04	a)
XS2455984679	3.3750 % MUBAUH 3 3/8 03/28/32 GMTN	200	0	0	200 USD	92.69%	185'375.00	0.04	a)
XS2455985569	3.0000 % MUBAUH 3 03/28/27 GMTN	200	0	0	200 USD	96.13%	192'268.00	0.04	a)
XS2457678469	3.8860 % SHARSK 3.886 04/04/30	200	0	0	200 USD	93.91%	187'812.00	0.04	a)
XS2460254282	3.1250 % CHGRID 3 1/8 04/07/25	200	0	0	200 USD	98.86%	197'720.00	0.04	a)
XS2472852610	5.7500 % DBKAZ 5 3/4 05/12/25 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2485248806	5.2500 % ROMANI 5 1/4 11/25/27 REGS	650	100	60	690 USD	100.01%	690'055.20	0.13	a)
XS2485249523	6.0000 % ROMANI 6 05/25/34 REGS	700	120	150	670 USD	100.63%	674'241.10	0.13	a)
XS2490731721	7.7500 % JORDAN 7 3/4 01/15/28 REGS	400	0	0	400 USD	102.36%	409'448.00	0.08	a)
XS2492384818	4.0500 % UAE 4.05 07/07/32 REGS	450	0	0	450 USD	98.24%	442'066.50	0.09	a)
XS2492385203	4.9510 % UAE 4.951 07/07/52 REGS	300	0	0	300 USD	98.50%	295'500.00	0.06	a)
XS2523929474	9.7580 % TURKSK 9.758 11/13/25 REGS	650	200	200	650 USD	104.91%	681'890.63	0.13	a)
XS2530049837	10.8750 % EGYSK 10 7/8 02/28/26 REGS	850	200	200	850 USD	104.91%	891'703.13	0.17	a)
XS2542162248	5.2500 % PIFKSA 5 1/4 10/13/32	400	0	200	200 USD	102.91%	205'812.50	0.04	a)
XS2542162321	5.0000 % PIFKSA 5 10/13/27	200	0	0	200 USD	101.13%	202'250.00	0.04	a)
XS2542162677	5.3750 % PIFKSA 5 3/8 10/13/2122	200	0	0	200 USD	89.84%	179'687.50	0.03	a)
XS2546781985	5.5000 % MUBAUH 5 1/2 04/28/33 REGS	200	0	0	200 USD	105.59%	211'187.50	0.04	a)
XS2548889406	5.2680 % KSA 5.268 10/25/28 REGS	500	0	0	500 USD	103.53%	517'656.25	0.10	a)
XS2548892020	5.5000 % KSA 5 1/2 10/25/32 REGS	500	0	0	500 USD	105.53%	527'656.25	0.10	a)
XS2571922884	6.6250 % ROMANI 6 5/8 02/17/28 REGS	1'050	150	60	1'140 USD	104.03%	1'185'956.25	0.23	a)
XS2571923007	7.1250 % ROMANI 7 1/8 01/17/33 REGS	980	120	0	1'100 USD	108.22%	1'190'406.25	0.23	a)
XS2571924070	7.6250 % ROMANI 7 5/8 01/17/53 REGS	820	100	0	920 USD	112.11%	1'031'435.00	0.20	a)
XS2574267188	6.1250 % REPHUN 6 1/8 05/22/28 REGS	1'450	200	200	1'450 USD	103.72%	1'503'921.88	0.29	a)
XS2574267261	6.2500 % REPHUN 6 1/4 09/22/32 REGS	1'150	200	0	1'350 USD	107.04%	1'444'972.50	0.28	a)
XS2574267345	6.7500 % REPHUN 6 3/4 09/25/52 REGS	800	0	0	800 USD	112.63%	901'000.00	0.18	a)
XS2577134401	4.7500 % KSA 4 3/4 01/18/28 REGS	700	0	0	700 USD	101.31%	709'187.50	0.14	a)
XS2577135127	4.8750 % KSA 4 7/8 07/18/33 REGS	700	0	0	700 USD	101.31%	709'187.50	0.14	a)
XS2577136109	5.0000 % KSA 5 01/18/53 REGS	600	0	0	600 USD	92.75%	556'500.00	0.11	a)
XS2580269426	6.2500 % SERBIA 6 1/4 05/26/28 REGS	550	0	0	550 USD	102.91%	565'984.38	0.11	a)
XS2580270275	6.5000 % SERBIA 6 1/2 09/26/33 REGS	700	0	0	700 USD	104.33%	730'275.00	0.14	a)
XS2582981952	8.2500 % SAFTRA 8 1/4 02/06/28 REGS	650	0	0	650 USD	102.84%	668'486.00	0.13	a)
XS2585987683	4.7500 % PIFKSA 4 3/4 02/14/30	300	0	0	300 USD	100.22%	300'656.25	0.06	a)
XS2585988061	4.8750 % PIFKSA 4 7/8 02/14/35	400	0	0	400 USD	98.72%	394'875.00	0.08	a)
XS2585988145	5.1250 % PIFKSA 5 1/8 02/14/53	250	200	0	450 USD	90.91%	409'078.13	0.08	a)
XS2587708624	6.5000 % SHJGOV 6 1/2 11/23/32 REGS	200	0	0	200 USD	106.31%	212'626.00	0.04	a)
XS2595028452	5.9500 % MOROC 5.95 03/08/28 REGS	850	0	0	850 USD	102.84%	874'171.88	0.17	a)
XS2595028700	6.5000 % MOROC 6 1/2 09/08/33 REGS	950	0	200	750 USD	106.76%	800'692.50	0.16	a)
XS2602742285	7.5000 % JORDAN 7 1/2 01/13/29 REGS	950	200	200	950 USD	101.50%	964'250.00	0.19	a)
XS2611617619	6.2500 % BHRAIN 6 1/4 10/18/30 REGS	600	0	0	600 USD	104.34%	626'062.50	0.12	a)
XS2611617700	7.7500 % BHRAIN 7 3/4 04/18/35 REGS	550	0	0	550 USD	107.31%	590'218.75	0.11	a)
XS2613748545	3.8750 % EXIMCH 3 7/8 05/16/26 EMTN	400	0	0	400 USD	99.39%	397'552.00	0.08	a)
XS2618838564	6.1250 % MAEXIM 6 1/8 12/04/27 REGS	800	0	0	800 USD	101.84%	814'750.00	0.16	a)
XS2621319040	5.3500 % CHILOV 5.35 08/15/33	400	200	0	600 USD	101.88%	611'256.00	0.12	a)
XS2623206187	5.0840 % MUBAUH 5.084 05/22/53 REGS	200	200	200	200 USD	98.88%	197'750.00	0.04	a)
XS2624479288	4.3750 % MUBAUH 4 3/8 11/22/33 REGS	200	0	0	200 USD	97.38%	194'750.00	0.04	a)
XS2625207571	5.3750 % BGOSK 5 3/8 05/22/33 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	102.37%	1'126'048.00	0.22	a)
XS2626270040	4.2740 % KSA 4.274 05/22/29 REGS	600	0	0	600 USD	99.72%	598'312.50	0.12	a)
XS2626274463	4.5110 % KSA 4.511 05/22/33 REGS	600	200	0	800 USD	99.63%	797'000.00	0.15	a)
XS2627125672	6.6250 % OILGAS 6 5/8 05/25/33	400	0	0	400 USD	106.03%	424'125.00	0.08	a)
XS2629043691	4.8760 % KNBZMK 4.876 06/01/33 EMTN	600	200	200	600 USD	100.53%	603'187.50	0.12	a)
XS2629054201	4.6870 % KNBZMK 4.687 06/01/28 EMTN	450	0	0	450 USD	100.41%	451'828.13	0.09	a)
XS2630760796	6.5000 % MAGYAR 6 1/2 06/29/28	700	200	0	900 USD	103.63%	932'625.00	0.18	a)
XS2634075399	7.5000 % MVMHU 7 1/2 06/09/28	500	0	0	500 USD	105.62%	528'100.00	0.10	a)
XS2677631355	5.5000 % DPWDU 5 1/2 09/13/33	400	200	200	400 USD	104.12%	416'484.00	0.08	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.
XS2680379695	6.0920 % SHARSK 6.092 03/19/34 EMTN	200	0	0	200 USD	105.72%	211'438.00	0.04	a)
XS2684502623	4.9170 % UAE 4.917 09/25/33 REGS	300	200	0	500 USD	103.78%	518'906.25	0.10	a)
XS2689091846	8.5091 % TURKSK 8.5091 01/14/29 REGS	525	200	0	725 USD	108.03%	783'226.56	0.15	a)
XS2689095086	5.8750 % ENEDEV 5 7/8 09/21/33 REGS	500	250	0	750 USD	102.97%	772'267.50	0.15	a)
XS2692231975	9.0000 % EXCRTU 9 01/28/27 REGS	200	0	0	200 USD	105.75%	211'500.00	0.04	a)
XS2699906512	9.3750 % TCZIRA 9 3/8 11/12/26	200	0	0	200 USD	106.76%	213'520.00	0.04	a)
XS2701166717	7.8500 % UZBEK 7.85 10/12/28 REGS	400	0	0	400 USD	104.88%	419'500.00	0.08	a)
XS2706163131	6.0000 % PIFKSA 6 10/25/28	500	0	0	500 USD	105.19%	525'937.50	0.10	a)
XS2706163305	6.2500 % PIFKSA 6 1/4 10/25/33	250	0	0	250 USD	110.78%	276'953.13	0.05	a)
XS2707149600	5.8750 % MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS	200	0	0	200 USD	108.59%	217'187.50	0.04	a)
XS2711511795	6.2500 % BGOSK 6 1/4 10/31/28 REGS	600	0	0	600 USD	106.65%	639'894.00	0.12	a)
XS2741927805	8.0000 % TCZIRA 8 01/16/29 REGS	200	0	0	200 USD	103.38%	206'750.00	0.04	a)
XS2744128369	5.5000 % REPHUN 5 1/2 03/26/36 REGS	1'550	400	200	1'750 USD	100.69%	1'762'031.25	0.34	a)
XS2747598444	4.7500 % KSA 4 3/4 01/16/30 REGS	550	200	0	750 USD	101.22%	759'140.63	0.15	a)
XS2747599095	5.0000 % KSA 5 01/16/34 REGS	700	400	200	900 USD	101.63%	914'625.00	0.18	a)
XS2747599509	5.7500 % KSA 5 3/4 01/16/54 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	102.00%	1'020'000.00	0.20	a)
XS2750476603	7.5000 % EXCRTU 7 1/2 02/06/28 REGS	0	200	0	200 USD	101.97%	203'946.00	0.04	a)
XS2752065040	7.6250 % IVYCS7 7 5/8 01/30/33 REGS	0	800	0	800 USD	99.77%	798'160.00	0.16	a)
XS2752065479	8.2500 % IVYCS7 8 1/4 01/30/37 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	99.63%	996'250.00	0.19	a)
XS2755904526	5.0000 % PIFKSA 5 01/29/29	0	500	0	500 USD	101.19%	505'937.50	0.10	a)
XS2755904799	5.2500 % PIFKSA 5 1/4 01/29/34	0	400	0	400 USD	101.94%	407'750.00	0.08	a)
XS2755904872	5.3750 % PIFKSA 5 3/8 01/29/54	0	200	0	200 USD	93.50%	187'000.00	0.04	a)
XS2756521212	5.8750 % ROMANI 5 7/8 01/30/29 REGS	0	1'560	200	1'360 USD	101.75%	1'383'800.00	0.27	a)
XS2756521303	6.3750 % ROMANI 6 3/8 01/30/34 REGS	0	1'600	150	1'450 USD	102.81%	1'490'781.25	0.29	a)
XS2759982064	7.9600 % BENIN 7.96 02/13/38 REGS	0	500	0	500 USD	95.72%	478'593.75	0.09	a)
XS2764424813	7.5000 % BHRAIN 7 1/2 02/12/36 REGS	0	650	0	650 USD	105.72%	687'171.88	0.13	a)
XS2764425117	6.0000 % BHRAIN 6 02/12/31 REGS	0	600	0	600 USD	103.14%	618'825.00	0.12	a)
XS2764457235	8.2500 % TURKWF 8 1/4 02/14/29	0	200	0	200 USD	103.91%	207'812.50	0.04	a)
XS2764839945	9.7500 % KENINT 9 3/4 02/16/31 REGS	0	1'300	200	1'100 USD	96.88%	1'065'625.00	0.21	a)
XS2764876475	5.5000 % MAZOOON 5 1/2 02/14/29 REGS	0	200	0	200 USD	100.53%	201'062.00	0.04	a)
XS2775892065	6.1250 % SHJGOV 6 1/8 03/06/36 REGS	0	200	0	200 USD	102.28%	204'562.50	0.04	a)
XS2777443768	5.1710 % PIFKSA 5.171 03/05/31	0	500	0	500 USD	102.22%	511'095.00	0.10	a)
XS2779850630	7.2500 % MONTEN 7 1/4 03/12/31 REGS	0	480	0	480 USD	103.28%	495'750.00	0.10	a)
XS2783579704	6.5000 % MVMHU 6 1/2 03/13/31	0	600	0	600 USD	102.50%	615'000.00	0.12	a)
XS2797416760	4.9590 % MUBAUH 4.959 04/04/34 EMTN	0	200	0	200 USD	103.06%	206'126.00	0.04	a)
XS2800066297	5.5000 % DBKAZ 5 1/2 04/15/27 REGS	0	300	0	300 USD	100.06%	300'189.00	0.06	a)
XS2800295052	5.6750 % SDBC FLOAT 04/16/27 EMTN	0	200	0	200 USD	99.97%	199'938.00	0.04	a)
XS2802184999	8.9941 % TCZIRA 8.9941 08/02/34 REGS	0	200	0	200 USD	103.41%	206'812.50	0.04	a)
XS2811094130	4.8750 % ADGB 4 7/8 04/30/29 REGS	0	400	0	400 USD	103.06%	412'252.00	0.08	a)
XS2811094213	5.5000 % ADGB 5 1/2 04/30/54 REGS	0	400	0	400 USD	107.31%	429'250.00	0.08	a)
XS2811094486	5.0000 % ADGB 5 04/30/34 REGS	0	500	0	500 USD	105.03%	525'155.00	0.10	a)
XS2816006303	5.3750 % ADQABU 5 3/8 05/08/29 REGS	0	300	0	300 USD	103.44%	310'314.00	0.06	a)
XS2816006725	5.5000 % ADQABU 5 1/2 05/08/34 REGS	0	300	0	300 USD	105.44%	316'314.00	0.06	a)
XS2822506759	4.6250 % QATAR 4 5/8 05/29/29 REGS	0	300	0	300 USD	102.38%	307'125.00	0.06	a)
XS2822506833	4.7500 % QATAR 4 3/4 05/29/34 REGS	0	500	0	500 USD	104.06%	520'312.50	0.10	a)
XS2827783437	6.9000 % UZBEK 6.9 02/28/32 REGS	0	500	0	500 USD	100.00%	500'000.00	0.10	a)
XS2829208169	5.2500 % KSA 5 1/4 06/04/34 REGS	0	450	0	450 USD	103.38%	465'187.50	0.09	a)
XS2829208599	5.2500 % KSA 5 1/4 06/04/30 REGS	0	300	0	300 USD	103.35%	310'047.00	0.06	a)
XS2829701718	5.1250 % LATVIA 5 1/8 07/30/34 REGS	0	850	0	850 USD	102.16%	868'377.00	0.17	a)
XS2830445727	5.2940 % MUBAUH 5.294 06/04/34 GMTN	0	200	0	200 USD	103.88%	207'750.00	0.04	a)
XS2830523465	5.2500 % KSA 5 1/4 06/04/27 REGS	0	350	0	350 USD	102.26%	357'896.00	0.07	a)
XS2837240261	5.7500 % ZAMBIN 5 3/4 06/30/33 REGS	0	907	0	907 USD	87.41%	670'517.58	0.13	a)
XS2837240428	0.5000 % ZAMBIN 0 1/2 12/31/53 REGS	0	970	0	970 USD	49.56%	480'847.45	0.09	a)
XS2838363476	7.7500 % SENEGL 7 3/4 06/10/31 7Y	0	600	0	600 USD	96.56%	579'375.00	0.11	a)
XS2838999691	6.0000 % SERBIA 6 06/12/34 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	101.29%	1'012'875.00	0.20	a)
XS2850662631	4.8570 % UAE 4.857 07/02/34 REGS	0	400	0	400 USD	103.25%	413'000.00	0.08	a)
XS2851607403	5.7500 % BGOSK 5 3/4 07/09/34 REGS	0	750	0	750 USD	104.81%	786'097.50	0.15	a)
XS2851609102	6.2500 % BGOSK 6 1/4 07/09/54 REGS	0	1'100	0	1'100 USD	107.99%	1'187'923.00	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.
XS285299793	5.6620 % ENEDEV 5.662 07/03/31 REGS	0	500	0	500 USD	101.72%	508'595.00	0.10	a)
USD							498'695'777.20	96.98	

Nicht kotierte Wertpapiere

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							3'803'513.06	0.74	
RU000A0JWHA4	4.7500 % RUSSIA 4 3/4 05/27/26 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
RU000A0JXTS9	4.2500 % RUSSIA 4 1/4 06/23/27 REGS	800	0	0	800 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
RU000A0JXU14	5.2500 % RUSSIA 5 1/4 06/23/47 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	0.00%	0.02	0.00	c)
RU000A0ZYNN4	4.3750 % RUSSIA 4 3/8 03/21/29 REGS	800	0	0	800 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
RU000A1006S9	5.1000 % RUSSIA 5.1 03/28/35 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
XS1303921487	41.7531 % UKRAIN 7 3/4 09/01/25 REGS	800	0	0	800 USD	36.10%	288'800.00	0.06	c)
XS1303925470	41.7531 % UKRAIN 7 3/4 09/01/27 REGS	900	0	0	900 USD	32.20%	289'800.00	0.06	c)
XS1303926528	41.7531 % UKRAIN 7 3/4 09/01/28 REGS	850	0	0	850 USD	31.00%	263'500.00	0.05	c)
XS1303927179	41.7531 % UKRAIN 7 3/4 09/01/29 REGS	800	0	0	800 USD	31.00%	248'000.00	0.05	c)
XS1577952952	39.5945 % UKRAIN 7 3/8 09/25/34 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	30.30%	606'000.00	0.12	c)
XS1843433472	8.2500 % RAILUA 8 1/4 07/09/26	400	0	0	400 USD	81.48%	325'908.00	0.06	c)
XS1902171591	49.0146 % UKRAIN 8.994 02/01/26 REGS	600	0	0	600 USD	35.50%	213'000.00	0.04	c)
XS1902171757	53.5031 % UKRAIN 9 3/4 11/01/30 REGS	1'050	0	0	1'050 USD	32.00%	336'000.00	0.07	c)
XS2010028699	36.7440 % UKRAIN 6.876 05/21/31 REGS	1'080	0	0	1'080 USD	30.20%	326'160.00	0.06	c)
XS2010030836	38.8953 % UKRAIN 7.253 03/15/35 REGS	1'490	0	0	1'490 USD	30.30%	451'470.00	0.09	c)
XS2077601610	7.6250 % NAFTA 7 5/8 11/08/28 REGS	200	200	200	200 USD	79.00%	158'000.00	0.03	c)
XS2357277149	33.2031 % UKRAVT 6 1/4 06/24/30 REGS	250	0	0	250 USD	30.75%	76'875.00	0.01	c)
XS2404309754	36.7383 % NPCUKR 6 7/8 11/09/28 REGS	400	0	0	400 USD	55.00%	220'000.00	0.04	c)
USD							3'803'513.06	0.74	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/USD	Verfall	29.05.2024	2'547'562	2'330'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	08.07.2024	6'768'753	6'100'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.09.2024	15'771'030	13'380'000	USD/CHF	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF	Verfall	03.04.2024	359'266'008	409'315'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	10'280'556	11'653'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	298'966	340'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	40'000	34'936	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	152'476	174'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	5'858'000	5'133'559	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	104'280	119'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	132'294	150'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	2'289'000	2'019'312	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	154'000	136'299	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	4'193'000	3'719'149	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	55'000	48'957	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	105'004	117'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	172'332	192'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	4'699'000	4'239'353	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.04.2024	203'737	225'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.04.2024	404'997'000	364'801'048	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2024	358'999'428	399'900'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2024	2'740'579	3'051'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2024	350'071	388'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2024	313'884	345'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2024	30'993	34'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.05.2024	133'000	121'081	USD/CHF	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.	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		49'122	54'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		120'000	109'581		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		48'403	53'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		685'664	750'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		404'322'000	370'844'138		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		357'968'493	391'701'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		2'896'000	2'637'074		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		111'842	124'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		94'746	105'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		52'000	47'105		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		368'496	407'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		138'351	153'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		613'118	678'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		10'000	9'031		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		2'216'123	2'425'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		5'628'084	6'166'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		398'801'000	359'758'382		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		368'515'288	409'828'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		1'528'629	1'710'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		324'672	364'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		391'000	347'935		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		370'556	413'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		191'152	215'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		593'642	665'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		7'798'000	6'947'519		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		2'066'322	2'323'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		2'268'774	2'538'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		387'000	347'011		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		409'480'000	367'942'349		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		375'621'120	419'755'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		5'549'942	6'163'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		952'042	1'058'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		6'040'876	6'728'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		458'295	512'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 05.08.2024		2'385'000	2'132'984		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		4'708'940	5'250'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		4'125'783	4'628'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		2'948'877	3'342'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 05.08.2024		445'051'000	391'738'341		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		402'642'212	459'088'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		2'250'015	2'628'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		142'989	169'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		182'000	154'669		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		563'424	654'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		82'648	97'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		334'313	397'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		462'851'000	392'641'595		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		413'736'524	489'336'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte auf Klassen								0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	4'725'209.16	0.92
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	502'499'290.26	97.72
Sonstige Vermögenswerte	7'015'417.96	1.36
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'239'917.38	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-143'174.96	
Andere Verbindlichkeiten	-8'645.00	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'088'097.42	

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);	498'695'777.14	96.98
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.	3'803'513.06	0.74

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CHF 1 = USD 1.17861984

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	487'638'075.74	94.855
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 Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
GTH1 CHF	USD	0.00 - 0.58	-	0.377	0.00 - 0.04	-	0.007
NT USD	USD	0.00 - 0.58	-	0.377	0.00 - 0.04	-	0.007
NTH1 CHF	USD	0.00 - 0.58	-	0.377	0.00 - 0.04	-	0.007
STH1 CHF	USD	0.00 - 0.58	-	0.377	0.00 - 0.04	-	0.007

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
GTH1 CHF	0.200	0.400	0.150	0.050	3.000
NT USD	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000
STH1 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.

8 Benchmark

J.P.Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified 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: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 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.

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.