

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD (EX CHF) GOVT. (I)

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	11704532	CHF
FA CHF	127002024	CHF
FAH1 CHF	31562131	CHF
GT CHF	127002027	CHF
GTH1 CHF	33096815	CHF
NT CHF	127002029	CHF
NTH1 CHF	11704531	CHF

Rechnungswährung: CHF

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	Collateral ausgeliehene Effekten	31
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	31
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	31
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	32
8	Pauschale Verwaltungskommission	32
9	Benchmark	32
10	TER	32
11	Fussnoten	33
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	34

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					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'357'423'565.94	1'239'149'039.41	1'011'107'250.39	981'248'192.20
Klasse DTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode				10'952'466.40	12'462'585.73
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				116'032.595	114'262.676
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)				94.3913	109.0696
Thesaurierung je Anteil				1.69	1.75
Total Expense Ratio (Synthetische TER)				0.20 %	0.20 %
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		947'286.22	889'994.99		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'452.091	12'385.098		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		70.4193	71.8601		
Ausschüttung je Anteil		-	1.55		
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %		
Klasse FAH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'012'425.31	17'614'475.36	6'010'392.02	7'284'756.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		181'188.553	242'599.522	81'115.045	84'089.939
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		71.8170	72.6072	74.0971	86.6305
Ausschüttung je Anteil		-	1.55	1.40	1.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.21 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		28'341'581.05	24'609'353.75		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		369'640.980	319'093.080		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		76.6733	77.1228		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		90.3686	87.5848		
Thesaurierung je Anteil		-	1.64		
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %		
Klasse GTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		226'050'812.18	193'417'880.73	172'906'830.22	26'622'815.71
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'733'548.902	2'346'891.690	2'082'497.748	277'561.239
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.6950	82.4145	83.0286	95.9169
Thesaurierung je Anteil		-	1.76	1.52	1.58
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		77'455'139.23	87'139'867.45		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		951'115.309	1'064'034.139		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.4361	81.8957		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		95.9822	93.0052		
Thesaurierung je Anteil		-	1.86		
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %		

	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
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'011'616'321.95	915'477'467.13	821'237'561.75	934'878'034.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'544'681.446	9'577'371.162	8'536'598.663	8'420'077.739
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		95.9362	95.5876	96.2020	111.0296
Thesaurierung je Anteil		-	2.19	1.92	2.01
Total Expense Ratio (Synthetische 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 10.08.2023)	-	-0.51 %	-15.31 %	-3.56 %
Klasse FA CHF (Lancierung 25.07.2023)	0.15 %	-0.35 %	-	-
Klasse FAH1 CHF	1.08 %	1.53 %	-15.32 %	-3.56 %
Klasse GT CHF (Lancierung 25.07.2023)	0.16 %	-0.34 %	-	-
Klasse GTH1 CHF	1.10 %	1.57 %	-15.28 %	-3.52 %
Klasse NT CHF (Lancierung 25.07.2023)	0.24 %	-0.28 %	-	-
Klasse NTH1 CHF	1.18 %	1.73 %	-15.14 %	-3.36 %
Benchmark Hedge	1.26 %	1.89 %	-15.21 %	-
Benchmark	0.22 %	-0.23 %	-	-3.37 %
Tracking Error ³³⁾	-	4.91 %	0.12 %	0.05 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FA CHF (Lancierung 25.07.2023)	-0.07 %
Klasse FAH1 CHF	-0.18 %
Klasse GT CHF (Lancierung 25.07.2023)	-0.06 %
Klasse GTH1 CHF	-0.16 %
Klasse NT CHF (Lancierung 25.07.2023)	0.02 %
Klasse NTH1 CHF	-0.08 %

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	27'270'353.66	6'095'868.15
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	693'208'187.53	663'102'723.22
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	628'483'265.67	591'274'267.63
Derivative Finanzinstrumente	-5'892.22	3'198.93
Sonstige Vermögenswerte	8'502'920.68	5'387'208.74
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'357'458'835.32	1'265'863'266.67
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-26'681'862.20
Andere Verbindlichkeiten	-35'269.38	-32'365.06
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'357'423'565.94	1'239'149'039.41

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse DTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		-	116'032.595
Ausgegebene Anteile		-	13'749.438
Zurückgenommene Anteile		-	-129'782.033
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	-
			<i>Lancierung</i>
	von bis	01.03.2024 31.08.2024	25.07.2023 29.02.2024
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'385.098	-
Ausgegebene Anteile		2'640.000	2'608.270
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		-	14'101.117
Zurückgenommene Anteile		-1'573.007	-4'324.289
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'452.091	12'385.098
			<i>Lancierung</i>
	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse FAH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		242'599.522	81'115.045
Ausgegebene Anteile		11'514.888	195'942.834
Zurückgenommene Anteile		-72'925.857	-34'458.357
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		181'188.553	242'599.522
			<i>Lancierung</i>
	von bis	01.03.2024 31.08.2024	25.07.2023 29.02.2024
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		319'093.080	-
Ausgegebene Anteile		57'390.000	46'846.270
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		-	293'393.910
Zurückgenommene Anteile		-6'842.100	-21'147.100
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		369'640.980	319'093.080
			<i>Lancierung</i>
	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse GTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'346'891.690	2'082'497.748
Ausgegebene Anteile		480'503.736	728'645.848
Zurückgenommene Anteile		-93'846.524	-464'251.906
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'733'548.902	2'346'891.690
			<i>Lancierung</i>
	von bis	01.03.2024 31.08.2024	25.07.2023 29.02.2024
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'064'034.139	-
Ausgegebene Anteile		32'576.722	57'393.578
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		-	1'168'679.429
Zurückgenommene Anteile		-145'495.552	-162'038.868
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		951'115.309	1'064'034.139
			<i>Lancierung</i>
	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'577'371.162	8'536'598.663
Ausgegebene Anteile		1'268'582.316	2'483'609.860
Zurückgenommene Anteile		-301'272.032	-1'442'837.361
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		10'544'681.446	9'577'371.162

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'239'149'039.41	1'011'107'250.39
Ausbezahlte Ausschüttung		-397'481.47	-115'497.55
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-10'215'691.92	-7'345'508.24
Saldo aus dem Anteilverkehr		113'017'435.03	230'735'039.45
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		15'870'264.89	4'767'755.36
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'357'423'565.94	1'239'149'039.41

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		52'314.90	73'438.15
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'794.95	-2'482.37
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		8'421'279.65	13'240'886.92
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		12'452'025.47	11'962'507.74
Erträge aus Wertpapierleihe		47'331.60	95'594.20
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		0.00	1'654'239.89
Sonstige Erträge		68'158.56	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'347'491.92	4'670'118.31
Total Ertrag		22'386'807.15	31'694'302.84
Aufwand			
Passivzinsen		-716.83	-1'018.66
Reglementarische Vergütungen		-203'192.95	-368'042.27
Sonstige Aufwendungen		-481.73	-407.30
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-560'191.06	-3'253'429.88
Total Aufwand		-764'582.57	-3'622'898.11
Nettoertrag / Verlust			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'559'894.16	-8'339'770.94
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		170'163.35	326'132.70
Realisierter Erfolg		20'232'493.77	20'057'766.49
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-4'362'228.88	-15'290'011.13
Gesamterfolg		15'870'264.89	4'767'755.36

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 CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							693'208'187.53	51.07	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							693'208'187.53	51.07	
JP1024451P27	0.0050 % JGB 0.005 02/01/25 445	60'000	0	60'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	117'000	0	117'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024471P49	0.0050 % JGB 0.005 04/01/25 447	131'000	0	0	131'000 JPY	99.88%	762'414.89	0.06	a)
JP1024481P54	0.0050 % JGB 0.005 05/01/25 448	65'000	0	0	65'000 JPY	99.85%	378'183.84	0.03	a)
JP1024491P60	0.0050 % JGB 0.005 06/01/25 449	110'000	0	110'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024501P76	0.0050 % JGB 0.005 07/01/25 450	85'000	0	0	85'000 JPY	99.81%	494'335.11	0.04	a)
JP1024511P82	0.0050 % JGB 0.005 08/01/25 451	85'000	0	0	85'000 JPY	99.78%	494'216.24	0.04	a)
JP1024521P98	0.0050 % JGB 0.005 09/01/25 452	145'000	0	0	145'000 JPY	99.76%	842'905.78	0.06	a)
JP1024531PA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/25 453	100'000	0	0	100'000 JPY	99.73%	581'133.69	0.04	a)
JP1024541PB7	0.1000 % JGB 0.1 11/01/25 454	85'000	0	0	85'000 JPY	99.81%	494'349.97	0.04	a)
JP1024561Q15	0.1000 % JGB 0.1 01/01/26 456	40'000	40'000	0	80'000 JPY	99.74%	464'972.22	0.03	a)
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	106'000	0	106'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051441L76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/25 144	152'000	0	0	152'000 JPY	99.89%	884'731.50	0.07	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	80'000	0	0	80'000 JPY	99.84%	465'419.74	0.03	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	101'000	0	0	101'000 JPY	99.76%	587'092.16	0.04	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	80'000	0	0	80'000 JPY	99.52%	463'941.99	0.03	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	85'950	0	0	85'950 JPY	99.40%	497'831.65	0.04	a)
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	105'000	0	0	105'000 JPY	99.27%	607'388.14	0.04	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	110'000	0	0	110'000 JPY	99.17%	635'670.40	0.05	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	115'300	0	0	115'300 JPY	99.07%	665'599.42	0.05	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	71'000	0	0	71'000 JPY	99.31%	410'859.01	0.03	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	156'000	0	0	156'000 JPY	98.99%	899'823.61	0.07	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	196'000	0	41'000	155'000 JPY	99.16%	895'627.07	0.07	a)
JP1051551P11	0.3000 % JGB 0.3 12/20/27 155	75'000	0	0	75'000 JPY	99.71%	435'745.38	0.03	a)
JP1051561P27	0.2000 % JGB 0.2 12/20/27 156	50'000	0	0	50'000 JPY	99.38%	289'547.11	0.02	a)
JP1051571P41	0.2000 % JGB 0.2 03/20/28 157	107'000	0	0	107'000 JPY	99.29%	619'063.43	0.05	a)
JP1051581P56	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 158	216'700	0	0	216'700 JPY	98.94%	1'249'341.17	0.09	a)
JP1051601P86	0.2000 % JGB 0.2 06/20/28 160	54'400	0	0	54'400 JPY	99.19%	314'434.48	0.02	a)
JP1051621PA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/28 162	60'000	0	0	60'000 JPY	99.49%	347'827.13	0.03	a)
JP1051631PB2	0.4000 % JGB 0.4 09/20/28 163	275'000	0	0	275'000 JPY	99.88%	1'600'585.41	0.12	a)
JP1051641Q12	0.2000 % JGB 0.2 12/20/28 164	100'000	0	0	100'000 JPY	98.93%	576'442.90	0.04	a)
JP1051691Q60	0.5000 % JGB 0.1/2 03/20/29 169	0	80'000	0	80'000 JPY	100.13%	466'771.62	0.03	a)
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	43'000	0	43'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	125'000	0	0	125'000 JPY	100.13%	729'316.08	0.05	a)
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	60'000	0	0	60'000 JPY	100.15%	350'162.62	0.03	a)
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	55'000	0	0	55'000 JPY	100.01%	320'533.72	0.02	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	35'000	0	0	35'000 JPY	99.67%	203'272.38	0.01	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	44'000	0	0	44'000 JPY	99.57%	255'288.60	0.02	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	70'000	0	0	70'000 JPY	99.47%	405'716.74	0.03	a)
JP1103451GC0	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	96'000	0	0	96'000 JPY	99.39%	555'975.20	0.04	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	80'000	0	0	80'000 JPY	99.31%	462'939.73	0.03	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	81'000	0	0	81'000 JPY	99.25%	468'457.44	0.03	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	113'000	0	0	113'000 JPY	99.16%	652'941.02	0.05	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	84'000	0	0	84'000 JPY	99.05%	484'843.46	0.04	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	71'000	0	0	71'000 JPY	98.94%	409'336.52	0.03	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	72'000	0	0	72'000 JPY	98.82%	414'594.17	0.03	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	58'000	0	0	58'000 JPY	98.69%	333'542.65	0.02	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	54'000	0	0	54'000 JPY	98.55%	310'083.45	0.02	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	68'000	0	0	68'000 JPY	98.35%	389'702.79	0.03	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	40'000	0	0	40'000 JPY	98.19%	228'861.67	0.02	a)
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	47'000	0	0	47'000 JPY	98.07%	268'594.77	0.02	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	55'000	0	0	55'000 JPY	97.93%	313'845.12	0.02	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	47'000	0	0	47'000 JPY	97.78%	267'784.11	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	80'000	0	0	80'000 JPY	97.62%	455'080.18	0.03	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	55'000	0	0	55'000 JPY	97.45%	312'316.38	0.02	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	57'000	0	0	57'000 JPY	97.22%	322'922.70	0.02	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	61'000	0	0	61'000 JPY	96.99%	344'752.19	0.03	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	89'000	0	0	89'000 JPY	96.75%	501'733.69	0.04	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	78'000	0	0	78'000 JPY	96.49%	438'544.47	0.03	a)
JP1103651N11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/31 365	74'000	0	0	74'000 JPY	96.21%	414'869.20	0.03	a)
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	46'000	0	0	46'000 JPY	96.38%	258'333.94	0.02	a)
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	39'000	0	0	39'000 JPY	98.25%	223'269.66	0.02	a)
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	168'950	0	0	168'950 JPY	97.94%	964'232.65	0.07	a)
JP1103711P74	0.4000 % JGB 0.4 06/20/33 371	196'350	0	0	196'350 JPY	96.89%	1'108'573.72	0.08	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	207'000	0	0	207'000 JPY	100.01%	1'206'275.86	0.09	a)
JP1103731Q12	0.6000 % JGB 0.6 12/20/33 373	70'000	240'000	0	310'000 JPY	98.01%	1'770'408.38	0.13	a)
JP1103741Q44	0.8000 % JGB 0.8 03/20/34 374	0	234'000	0	234'000 JPY	99.45%	1'356'021.31	0.10	a)
JP1103751Q74	1.1000 % JGB 1.1 06/20/34 375	0	80'000	0	80'000 JPY	101.95%	475'255.83	0.04	a)
JP1200751533	2.1000 % JGB 2.1 03/20/25 75	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200761540	1.9000 % JGB 1.9 03/20/25 76	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200781563	1.9000 % JGB 1.9 06/20/25 78	6'000	0	0	6'000 JPY	101.32%	35'425.32	0.00	a)
JP1200811592	2.0000 % JGB 2 09/20/25 81	30'000	0	0	30'000 JPY	101.83%	178'007.67	0.01	a)
JP12008215A7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/25 82	20'000	0	0	20'000 JPY	101.93%	118'794.15	0.01	a)
JP12008315C1	2.1000 % JGB 2.1 12/20/25 83	30'000	0	0	30'000 JPY	102.34%	178'907.95	0.01	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	40'000	0	0	40'000 JPY	102.21%	238'243.25	0.02	a)
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	60'000	0	0	60'000 JPY	102.74%	359'217.89	0.03	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	30'000	0	0	30'000 JPY	103.05%	180'147.37	0.01	a)
JP1200871653	2.2000 % JGB 2.2 03/20/26 87	40'000	0	0	40'000 JPY	102.90%	239'837.54	0.02	a)
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	63'000	0	0	63'000 JPY	103.50%	379'954.10	0.03	a)
JP1200891685	2.2000 % JGB 2.2 06/20/26 89	25'000	0	0	25'000 JPY	103.32%	150'514.67	0.01	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	82'000	0	0	82'000 JPY	103.76%	495'780.98	0.04	a)
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	96'000	0	0	96'000 JPY	103.97%	581'606.85	0.04	a)
JP1200931739	2.0000 % JGB 2 03/20/27 93	50'000	0	0	50'000 JPY	104.12%	303'368.92	0.02	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	64'000	0	0	64'000 JPY	104.38%	389'252.01	0.03	a)
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	50'000	0	0	50'000 JPY	105.37%	307'002.10	0.02	a)
JP1200961785	2.1000 % JGB 2.1 06/20/27 96	25'000	0	0	25'000 JPY	104.82%	152'695.46	0.01	a)
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	45'000	0	0	45'000 JPY	105.53%	276'705.70	0.02	a)
JP12009817B7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/27 98	36'000	0	0	36'000 JPY	105.22%	220'731.04	0.02	a)
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	117'000	0	0	117'000 JPY	105.60%	719'959.79	0.05	a)
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	90'000	0	0	90'000 JPY	106.35%	557'758.98	0.04	a)
JP1201011853	2.4000 % JGB 2.4 03/20/28 101	30'000	0	0	30'000 JPY	107.05%	187'143.35	0.01	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	77'000	0	0	77'000 JPY	107.46%	482'142.78	0.04	a)
JP1201031877	2.3000 % JGB 2.3 06/20/28 103	35'000	0	0	35'000 JPY	107.08%	218'393.05	0.02	a)
JP1201041884	2.1000 % JGB 2.1 06/20/28 104	30'000	0	0	30'000 JPY	106.34%	185'886.45	0.01	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	56'000	0	0	56'000 JPY	106.69%	348'152.98	0.03	a)
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	33'000	0	0	33'000 JPY	107.09%	205'928.83	0.02	a)
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	30'000	0	0	30'000 JPY	107.03%	187'094.40	0.01	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	50'000	0	0	50'000 JPY	106.18%	309'364.97	0.02	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	40'000	0	0	40'000 JPY	106.41%	248'016.41	0.02	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	60'000	0	0	60'000 JPY	107.30%	375'136.28	0.03	a)
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	50'000	0	0	50'000 JPY	108.08%	314'906.52	0.02	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	65'000	10'700	0	75'700 JPY	107.62%	474'699.66	0.03	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	60'000	0	0	60'000 JPY	108.03%	377'709.51	0.03	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	61'000	0	0	61'000 JPY	108.36%	385'174.11	0.03	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	40'000	0	0	40'000 JPY	108.88%	253'775.89	0.02	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	60'000	0	0	60'000 JPY	109.28%	382'058.84	0.03	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	102'000	0	0	102'000 JPY	108.74%	646'290.47	0.05	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	50'000	0	0	50'000 JPY	108.50%	316'106.89	0.02	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	39'000	0	0	39'000 JPY	107.31%	243'863.58	0.02	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	60'000	0	0	60'000 JPY	106.18%	371'237.97	0.03	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	64'000	0	0	64'000 JPY	108.12%	403'229.51	0.03	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	39'000	0	0	39'000 JPY	107.54%	244'383.99	0.02	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	109'000	0	0	109'000 JPY	109.60%	696'093.33	0.05	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	51'000	0	0	51'000 JPY	108.99%	323'882.24	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	66'000	0	0	66'000 JPY	110.51%	425'022.06	0.03	a)
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	55'000	0	0	55'000 JPY	109.18%	349'909.73	0.03	a)
JP1201271B58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/31 127	45'000	0	0	45'000 JPY	108.55%	284'632.56	0.02	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	74'000	0	0	74'000 JPY	108.72%	468'786.85	0.03	a)
JP1201291B88	1.8000 % JGB 1.8 06/20/31 129	30'000	0	0	30'000 JPY	108.06%	188'905.45	0.01	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	84'000	0	0	84'000 JPY	108.19%	529'552.00	0.04	a)
JP1201311BB0	1.7000 % JGB 1.7 09/20/31 131	45'000	0	0	45'000 JPY	107.51%	281'913.36	0.02	a)
JP1201321BC7	1.7000 % JGB 1.7 12/20/31 132	64'000	0	0	64'000 JPY	107.59%	401'241.78	0.03	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	80'000	0	0	80'000 JPY	108.37%	505'165.01	0.04	a)
JP1201341C38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/32 134	82'000	0	0	82'000 JPY	108.45%	518'209.84	0.04	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	30'000	0	0	30'000 JPY	107.73%	188'330.32	0.01	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	40'000	0	0	40'000 JPY	107.01%	249'426.57	0.02	a)
JP1201371C64	1.7000 % JGB 1.7 06/20/32 137	38'000	0	0	38'000 JPY	107.80%	238'689.02	0.02	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	40'000	0	0	40'000 JPY	106.23%	247'608.52	0.02	a)
JP1201391C86	1.6000 % JGB 1.6 06/20/32 139	50'000	0	0	50'000 JPY	106.97%	311'672.49	0.02	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	150'000	0	0	150'000 JPY	107.84%	942'595.58	0.07	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	99'000	0	0	99'000 JPY	107.89%	622'413.06	0.05	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	57'000	0	0	57'000 JPY	108.68%	360'966.36	0.03	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	83'000	0	0	83'000 JPY	107.03%	517'642.34	0.04	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	45'000	0	0	45'000 JPY	106.23%	278'541.23	0.02	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	93'000	0	0	93'000 JPY	107.86%	584'523.06	0.04	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	107'000	0	0	107'000 JPY	107.87%	672'590.60	0.05	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	79'000	0	0	79'000 JPY	106.92%	492'180.15	0.04	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	133'000	0	0	133'000 JPY	105.81%	820'020.08	0.06	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	109'000	0	0	109'000 JPY	105.65%	671'049.34	0.05	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	117'950	0	0	117'950 JPY	104.54%	718'485.84	0.05	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	117'000	0	0	117'000 JPY	102.45%	698'450.03	0.05	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	119'000	0	0	119'000 JPY	102.19%	708'572.59	0.05	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	96'000	0	0	96'000 JPY	102.99%	576'113.55	0.04	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	119'000	0	0	119'000 JPY	101.73%	705'410.58	0.05	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	119'000	0	0	119'000 JPY	99.42%	689'378.68	0.05	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	80'000	0	0	80'000 JPY	92.64%	431'837.17	0.03	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	95'500	0	0	95'500 JPY	90.02%	500'942.40	0.04	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	131'000	0	0	131'000 JPY	92.87%	708'942.49	0.05	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	122'000	0	0	122'000 JPY	93.60%	665'411.89	0.05	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	102'000	0	0	102'000 JPY	94.35%	560'767.85	0.04	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	97'000	0	0	97'000 JPY	92.82%	524'631.27	0.04	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	134'000	0	15'000	119'000 JPY	92.46%	641'130.43	0.05	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	116'000	0	0	116'000 JPY	92.01%	621'946.02	0.05	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	129'300	0	0	129'300 JPY	90.29%	680'296.18	0.05	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	153'000	0	0	153'000 JPY	89.91%	801'620.81	0.06	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	117'000	0	0	117'000 JPY	91.98%	627'116.73	0.05	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	129'000	0	0	129'000 JPY	89.03%	669'261.48	0.05	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	126'500	0	0	126'500 JPY	87.33%	643'701.21	0.05	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	152'000	0	0	152'000 JPY	85.50%	757'268.30	0.06	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	130'000	22'000	18'000	134'000 JPY	85.01%	663'765.74	0.05	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	164'700	0	0	164'700 JPY	84.51%	811'010.06	0.06	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	149'000	0	0	149'000 JPY	85.35%	741'071.96	0.05	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	193'000	0	0	193'000 JPY	84.96%	955'514.72	0.07	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	190'000	0	0	190'000 JPY	84.46%	935'093.23	0.07	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	191'000	0	0	191'000 JPY	85.46%	951'166.74	0.07	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	154'000	0	0	154'000 JPY	85.08%	763'472.38	0.06	a)
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	224'000	0	15'000	209'000 JPY	83.16%	1'012'794.76	0.07	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	193'000	0	0	193'000 JPY	84.19%	946'843.87	0.07	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	215'000	0	0	215'000 JPY	83.69%	1'048'497.63	0.08	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	192'000	0	0	192'000 JPY	87.92%	983'669.09	0.07	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	197'000	0	0	197'000 JPY	89.05%	1'022'234.15	0.08	a)
JP1201821NA5	1.1000 % JGB 1.1 09/20/42 182	164'000	15'000	15'000	164'000 JPY	91.83%	877'592.40	0.06	a)
JP1201831P14	1.4000 % JGB 1.4 12/20/42 183	165'000	0	0	165'000 JPY	96.23%	925'171.19	0.07	a)
JP1201841P46	1.1000 % JGB 1.1 03/20/43 184	159'000	0	0	159'000 JPY	91.18%	844'786.47	0.06	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	180'150	0	0	180'150 JPY	90.85%	953'642.36	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP1201861PA6	1.5000 % JGB 1 1/2 09/20/43 186	191'000	0	0	191'000 JPY	96.90%	1'078'490.55	0.08	a)
JP1201871Q14	1.3000 % JGB 1.3 12/20/43 187	60'000	95'000	0	155'000 JPY	93.45%	844'018.46	0.06	a)
JP1201881Q46	1.6000 % JGB 1.6 03/20/44 188	0	140'000	0	140'000 JPY	98.05%	799'906.37	0.06	a)
JP1201891Q77	1.9000 % JGB 1.9 06/20/44 189	0	55'000	0	55'000 JPY	102.78%	329'401.64	0.02	a)
JP1300071253	2.3000 % JGB 2.3 05/20/32 7	35'000	0	0	35'000 JPY	112.19%	228'800.49	0.02	a)
JP13000812B5	1.8000 % JGB 1.8 11/22/32 8	25'000	0	0	25'000 JPY	108.66%	158'290.90	0.01	a)
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	40'000	0	0	40'000 JPY	107.86%	251'407.77	0.02	a)
JP13001213B5	2.1000 % JGB 2.1 09/20/33 12	20'000	0	0	20'000 JPY	111.35%	129'771.18	0.01	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	31'000	0	0	31'000 JPY	110.47%	199'559.32	0.01	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	50'000	0	0	50'000 JPY	114.06%	332'323.63	0.02	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	63'000	0	0	63'000 JPY	114.99%	422'127.17	0.03	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	35'000	0	0	35'000 JPY	115.09%	234'725.16	0.02	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	40'000	0	0	40'000 JPY	114.14%	266'050.03	0.02	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	60'000	0	0	60'000 JPY	113.25%	395'942.41	0.03	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	41'000	0	0	41'000 JPY	113.18%	270'398.19	0.02	a)
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	33'000	10'000	0	43'000 JPY	115.32%	288'945.41	0.02	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	40'000	0	0	40'000 JPY	113.22%	263'903.34	0.02	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	49'000	10'000	0	59'000 JPY	115.28%	396'339.65	0.03	a)
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	53'000	0	0	53'000 JPY	115.32%	356'142.01	0.03	a)
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	39'700	0	0	39'700 JPY	115.32%	266'777.47	0.02	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	43'000	0	0	43'000 JPY	113.04%	283'232.55	0.02	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	92'000	0	0	92'000 JPY	114.09%	611'609.50	0.05	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	93'000	0	0	93'000 JPY	115.27%	624'646.64	0.05	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	125'000	0	0	125'000 JPY	115.05%	837'983.65	0.06	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	109'000	0	0	109'000 JPY	113.73%	722'325.05	0.05	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	146'000	0	13'000	133'000 JPY	112.29%	870'240.10	0.06	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	126'000	0	0	126'000 JPY	110.70%	812'800.75	0.06	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	148'000	0	0	148'000 JPY	111.74%	963'652.87	0.07	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	180'000	0	0	180'000 JPY	107.30%	1'125'450.79	0.08	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	155'000	0	0	155'000 JPY	109.75%	991'248.41	0.07	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	182'000	0	0	182'000 JPY	106.57%	1'130'192.74	0.08	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	167'750	0	0	167'750 JPY	106.17%	1'037'753.32	0.08	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	212'000	0	0	212'000 JPY	104.34%	1'288'940.19	0.09	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	114'000	0	0	114'000 JPY	102.31%	679'597.77	0.05	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	108'000	0	0	108'000 JPY	103.63%	652'180.59	0.05	a)
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	80'000	0	0	80'000 JPY	101.79%	474'528.61	0.03	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	72'000	0	0	72'000 JPY	99.94%	419'276.33	0.03	a)
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	91'000	0	0	91'000 JPY	99.66%	528'449.87	0.04	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	69'000	0	0	69'000 JPY	99.53%	400'174.09	0.03	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	63'000	5'000	0	68'000 JPY	99.25%	393'249.14	0.03	a)
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	52'000	0	0	52'000 JPY	95.68%	289'914.68	0.02	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	89'350	0	0	89'350 JPY	95.36%	496'495.81	0.04	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	41'000	0	0	41'000 JPY	96.84%	231'365.10	0.02	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	40'000	0	0	40'000 JPY	93.06%	216'916.18	0.02	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	58'000	0	0	58'000 JPY	92.87%	313'882.93	0.02	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	74'000	0	0	74'000 JPY	81.97%	353'440.00	0.03	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	74'000	0	0	74'000 JPY	72.69%	313'432.97	0.02	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	102'000	0	0	102'000 JPY	75.82%	450'638.67	0.03	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	68'000	0	0	68'000 JPY	77.28%	306'195.05	0.02	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	54'000	0	0	54'000 JPY	80.55%	253'444.33	0.02	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	81'000	0	0	81'000 JPY	80.28%	378'915.72	0.03	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	85'000	0	0	85'000 JPY	79.89%	395'700.88	0.03	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	90'000	0	0	90'000 JPY	79.63%	417'598.14	0.03	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	86'000	0	0	86'000 JPY	79.24%	397'083.82	0.03	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	125'000	0	0	125'000 JPY	77.03%	561'081.29	0.04	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	71'000	0	0	71'000 JPY	80.42%	332'731.76	0.02	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	104'000	0	28'000	76'000 JPY	76.25%	337'656.56	0.02	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	77'600	11'000	0	88'600 JPY	71.99%	371'658.50	0.03	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	105'000	0	0	105'000 JPY	69.57%	425'646.49	0.03	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	90'000	0	0	90'000 JPY	69.16%	362'705.39	0.03	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	127'650	0	0	127'650 JPY	68.87%	512'250.30	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	119'700	0	0	119'700 JPY	68.47%	477'543.57	0.04	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	135'000	0	0	135'000 JPY	72.05%	566'784.53	0.04	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	153'000	0	0	153'000 JPY	71.66%	638'834.21	0.05	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	167'000	0	24'000	143'000 JPY	73.36%	611'270.95	0.05	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	146'000	0	0	146'000 JPY	72.97%	620'802.40	0.05	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	133'000	0	0	133'000 JPY	72.70%	563'440.73	0.04	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	165'000	0	0	165'000 JPY	72.31%	695'274.92	0.05	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	161'000	0	0	161'000 JPY	72.05%	675'924.27	0.05	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	158'000	0	0	158'000 JPY	78.05%	718'588.45	0.05	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	132'000	0	0	132'000 JPY	84.02%	646'259.36	0.05	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	141'300	0	0	141'300 JPY	85.96%	707'772.78	0.05	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	131'000	0	0	131'000 JPY	90.00%	687'034.45	0.05	a)
JP1300781P48	1.4000 % JGB 1.4 03/20/53 78	160'000	0	0	160'000 JPY	85.53%	797'394.91	0.06	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	151'000	0	0	151'000 JPY	81.10%	713'580.02	0.05	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	123'000	0	0	123'000 JPY	93.76%	672'034.35	0.05	a)
JP1300811Q17	1.6000 % JGB 1.6 12/20/53 81	55'000	93'000	0	148'000 JPY	89.34%	770'508.34	0.06	a)
JP1300821Q49	1.8000 % JGB 1.8 03/20/54 82	0	154'000	0	154'000 JPY	93.38%	837'980.91	0.06	a)
JP1300831Q70	2.2000 % JGB 2.2 06/20/54 83	0	30'000	0	30'000 JPY	102.08%	178'451.69	0.01	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	36'000	0	0	36'000 JPY	109.52%	229'736.66	0.02	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	72'000	0	0	72'000 JPY	105.03%	440'631.38	0.03	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	61'000	0	0	61'000 JPY	104.31%	370'771.22	0.03	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	96'000	0	0	96'000 JPY	103.74%	580'342.61	0.04	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	103'000	0	0	103'000 JPY	98.91%	593'628.15	0.04	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	63'000	0	0	63'000 JPY	96.26%	353'386.68	0.03	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	65'000	0	0	65'000 JPY	91.25%	345'625.66	0.03	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	63'150	0	0	63'150 JPY	84.17%	309'724.64	0.02	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	138'000	0	0	138'000 JPY	60.65%	487'732.40	0.04	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	116'000	0	0	116'000 JPY	71.12%	480'748.89	0.04	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	125'500	0	0	125'500 JPY	67.75%	495'446.60	0.04	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	153'000	0	0	153'000 JPY	59.44%	529'887.82	0.04	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	220'000	0	0	220'000 JPY	58.36%	748'149.17	0.06	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	205'000	0	0	205'000 JPY	62.06%	741'301.49	0.05	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	208'800	0	0	208'800 JPY	68.33%	831'365.79	0.06	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	139'100	67'000	0	206'100 JPY	74.90%	899'542.41	0.07	a)
JP1400171Q50	2.2000 % JGB 2.2 03/20/64 17	0	80'000	0	80'000 JPY	96.89%	451'653.86	0.03	a)
JP1480011Q23	0.7000 % JGB 0.7 12/20/33 1	0	40'000	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JPY							138'717'185.77	10.22	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	554	0	0	554 USD	102.58%	482'159.52	0.04	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	389	0	0	389 USD	106.88%	352'737.78	0.03	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	505	0	0	505 USD	105.66%	452'702.43	0.03	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	367	0	0	367 USD	112.41%	350'011.88	0.03	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	387	0	0	387 USD	109.03%	358'004.28	0.03	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	442	0	0	442 USD	105.84%	396'929.84	0.03	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	336	0	0	336 USD	110.33%	314'522.52	0.02	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	390	0	0	390 USD	104.00%	344'131.32	0.03	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	397	0	0	397 USD	105.16%	354'202.68	0.03	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	423	0	0	423 USD	94.08%	337'641.06	0.02	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	663	0	0	663 USD	102.00%	573'772.80	0.04	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	678	0	0	678 USD	104.59%	601'674.61	0.04	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	802	0	0	802 USD	103.19%	702'146.46	0.05	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	642	0	0	642 USD	106.03%	577'557.42	0.04	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	717	0	0	717 USD	103.16%	627'539.34	0.05	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	551	0	0	551 USD	97.03%	453'617.17	0.03	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	493	0	0	493 USD	101.41%	424'167.99	0.03	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	817	0	0	817 USD	107.44%	744'739.19	0.05	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	667	0	0	667 USD	102.59%	580'594.60	0.04	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	850	0	0	850 USD	94.59%	682'193.58	0.05	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	826	0	0	826 USD	86.53%	606'428.05	0.04	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	780	0	0	780 USD	86.09%	569'760.69	0.04	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	805	0	0	805 USD	84.08%	574'255.45	0.04	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	898	0	0	898 USD	80.63%	614'288.41	0.05	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 CHF	in % 7)	Kat.
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	1'201	0	0	1'201 USD	80.33%	818'534.26	0.06	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	1'117	0	0	1'117 USD	84.81%	803'783.88	0.06	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'638	0	0	1'638 USD	81.31%	1'130'049.49	0.08	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	1'154	0	0	1'154 USD	90.89%	889'920.33	0.07	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	1'249	0	0	1'249 USD	92.44%	979'573.18	0.07	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	1'524	0	0	1'524 USD	90.67%	1'172'421.68	0.09	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	1'186	0	0	1'186 USD	87.25%	877'963.33	0.06	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	1'587	0	0	1'587 USD	83.75%	1'127'685.50	0.08	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	1'371	0	0	1'371 USD	81.97%	953'480.95	0.07	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	1'824	0	0	1'824 USD	75.09%	1'162'130.45	0.09	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	890	0	0	890 USD	81.70%	616'957.01	0.05	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	1'123	0	0	1'123 USD	79.86%	760'907.64	0.06	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	550	0	0	550 USD	81.44%	380'026.06	0.03	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	1'493	0	0	1'493 USD	74.22%	940'155.52	0.07	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	1'450	0	0	1'450 USD	73.98%	910'194.68	0.07	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	1'881	0	0	1'881 USD	70.27%	1'121'393.23	0.08	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	865	0	0	865 USD	78.95%	579'444.25	0.04	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	1'660	0	0	1'660 USD	80.56%	1'134'664.00	0.08	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	1'139	0	0	1'139 USD	80.44%	777'335.58	0.06	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'871	0	150	1'721 USD	76.63%	1'118'864.80	0.08	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'762	0	0	1'762 USD	76.45%	1'142'950.36	0.08	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	2'084	0	0	2'084 USD	79.94%	1'413'430.73	0.10	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	2'234	0	0	2'234 USD	81.69%	1'548'335.34	0.11	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	2'417	0	0	2'417 USD	79.72%	1'634'795.32	0.12	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	2'506	0	400	2'106 USD	85.22%	1'522'719.05	0.11	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'408	0	0	2'408 USD	79.56%	1'625'515.66	0.12	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	2'180	0	0	2'180 USD	77.61%	1'435'479.39	0.11	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	2'447	0	0	2'447 USD	68.06%	1'413'084.46	0.10	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	2'194	0	0	2'194 USD	69.86%	1'300'431.87	0.10	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	2'859	0	0	2'859 USD	64.05%	1'553'597.05	0.11	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'977	0	0	2'977 USD	52.53%	1'326'853.04	0.10	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	3'757	0	200	3'557 USD	54.16%	1'634'401.31	0.12	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	2'774	0	0	2'774 USD	64.13%	1'509'246.19	0.11	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	2'461	0	150	2'311 USD	64.66%	1'267'759.03	0.09	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	3'731	0	0	3'731 USD	57.81%	1'830'093.40	0.13	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	2'854	0	0	2'854 USD	66.38%	1'607'254.89	0.12	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	4'166	0	200	3'966 USD	61.67%	2'075'229.59	0.15	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	3'731	0	0	3'731 USD	71.84%	2'274'262.00	0.17	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	4'086	0	0	4'086 USD	69.38%	2'405'069.40	0.18	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'900	0	0	2'900 USD	75.98%	1'869'599.47	0.14	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'971	0	0	3'971 USD	63.38%	2'135'227.30	0.16	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	4'135	0	0	4'135 USD	69.48%	2'437'748.82	0.18	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'974	0	0	3'974 USD	61.33%	2'067'824.94	0.15	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	3'472	0	0	3'472 USD	72.13%	2'124'671.52	0.16	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'430	0	0	3'430 USD	67.28%	1'958'007.84	0.14	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	2'833	0	0	2'833 USD	76.38%	1'835'794.45	0.14	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	3'413	0	0	3'413 USD	77.27%	2'237'426.80	0.16	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	2'400	0	0	2'400 USD	87.11%	1'773'790.88	0.13	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	3'124	0	0	3'124 USD	79.33%	2'102'637.67	0.15	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	2'003	0	0	2'003 USD	88.47%	1'503'478.06	0.11	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	3'180	0	0	3'180 USD	95.95%	2'588'883.31	0.19	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	2'209	0	0	2'209 USD	96.47%	1'808'042.44	0.13	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	3'094	0	0	3'094 USD	89.70%	2'354'800.46	0.17	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	2'090	0	0	2'090 USD	94.63%	1'677'947.75	0.12	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	2'990	0	0	2'990 USD	89.77%	2'277'233.05	0.17	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	2'124	0	0	2'124 USD	94.41%	1'701'302.39	0.13	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	3'400	0	0	3'400 USD	98.19%	2'832'444.27	0.21	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	2'289	0	0	2'289 USD	100.98%	1'961'219.72	0.14	a)
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	3'447	150	0	3'597 USD	108.94%	3'324'635.95	0.24	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	1'600	300	0	1'900 USD	106.00%	1'708'778.30	0.13	a)
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	0	3'409	0	3'409 USD	100.41%	2'904'116.28	0.21	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 CHF	in % 7)	Kat.
US912810TZ12	4.5000 % T 4 1/2 02/15/44	0	2'250	0	2'250 USD	102.50%	1'956'737.81	0.14	a)
US912810UA42	4.6250 % T 4 5/8 05/15/54	0	3'419	0	3'419 USD	106.91%	3'101'190.54	0.23	a)
US912810UB25	4.6250 % T 4 5/8 05/15/44	0	1'100	0	1'100 USD	104.16%	972'085.07	0.07	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	3'450	0	0	3'450 USD	95.44%	2'793'601.17	0.21	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	2'432	0	0	2'432 USD	95.70%	1'974'767.27	0.15	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	2'626	0	0	2'626 USD	95.38%	2'124'983.33	0.16	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	1'110	0	1'110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	3'414	0	0	3'414 USD	96.63%	2'798'847.77	0.21	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	1'610	0	1'610	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	1'032	0	1'032	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	1'490	0	1'490	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	3'631	0	0	3'631 USD	96.89%	2'984'930.60	0.22	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'657	0	0	3'657 USD	96.72%	3'000'971.63	0.22	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	1'150	0	0	1'150 USD	98.41%	960'167.01	0.07	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	1'150	0	0	1'150 USD	98.59%	961'996.48	0.07	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	1'250	0	0	1'250 USD	98.55%	1'045'151.25	0.08	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	3'274	0	0	3'274 USD	97.48%	2'707'945.77	0.20	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	1'810	0	0	1'810 USD	98.34%	1'510'259.56	0.11	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	1'450	0	0	1'450 USD	97.98%	1'205'455.28	0.09	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	1'640	0	0	1'640 USD	97.92%	1'362'541.83	0.10	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	3'371	0	0	3'371 USD	95.38%	2'727'844.17	0.20	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	1'450	0	0	1'450 USD	97.67%	1'201'610.75	0.09	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	1'300	0	0	1'300 USD	97.22%	1'072'308.23	0.08	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	1'450	0	0	1'450 USD	97.34%	1'197'573.92	0.09	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'752	0	0	2'752 USD	94.09%	2'197'027.34	0.16	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	1'570	0	0	1'570 USD	96.84%	1'290'023.16	0.10	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	1'250	0	0	1'250 USD	96.31%	1'021'454.26	0.08	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	2'996	0	2'996	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	3'152	0	0	3'152 USD	97.75%	2'614'142.33	0.19	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	3'420	0	0	3'420 USD	97.64%	2'833'236.89	0.21	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	3'120	0	0	3'120 USD	96.50%	2'554'513.26	0.19	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	2'755	0	0	2'755 USD	96.06%	2'245'278.48	0.17	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	2'785	0	0	2'785 USD	96.03%	2'269'480.25	0.17	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'530	0	0	2'530 USD	96.25%	2'066'081.81	0.15	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	3'206	0	0	3'206 USD	96.25%	2'618'125.80	0.19	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	2'905	0	2'905	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	750	0	0	750 USD	98.62%	627'563.01	0.05	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	1'156	0	0	1'156 USD	98.61%	967'168.88	0.07	a)
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	1'850	0	0	1'850 USD	96.19%	1'509'790.26	0.11	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	2'550	0	0	2'550 USD	90.58%	1'959'700.65	0.14	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	1'150	0	0	1'150 USD	95.13%	928'151.27	0.07	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	1'200	0	0	1'200 USD	95.47%	972'005.53	0.07	a)
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	1'530	0	0	1'530 USD	95.30%	1'237'075.96	0.09	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	1'657	0	0	1'657 USD	90.66%	1'274'519.58	0.09	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	1'150	0	0	1'150 USD	95.17%	928'608.69	0.07	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	1'650	0	0	1'650 USD	95.34%	1'334'757.68	0.10	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	1'634	0	1'634	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	4'309	0	0	4'309 USD	94.63%	3'459'462.61	0.25	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	3'280	0	0	3'280 USD	88.88%	2'473'316.60	0.18	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	800	0	0	800 USD	93.59%	635'276.94	0.05	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	1'150	0	0	1'150 USD	92.17%	899'337.16	0.07	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	2'430	0	2'430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'900	0	0	1'900 USD	91.66%	1'477'549.16	0.11	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	4'421	0	0	4'421 USD	84.00%	3'150'837.86	0.23	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	1'730	0	0	1'730 USD	91.44%	1'342'136.54	0.10	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	3'018	0	3'018	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	2'000	0	0	2'000 USD	91.20%	1'547'625.74	0.11	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	2'659	0	0	2'659 USD	96.59%	2'179'182.58	0.16	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 CHF	in % 7)	Kat.
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	2'772	0	0	2'772 USD	96.28%	2'264'441.99	0.17	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	2'406	0	0	2'406 USD	90.63%	1'849'992.20	0.14	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	5'494	0	0	5'494 USD	83.34%	3'884'972.48	0.29	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	2'137	0	0	2'137 USD	90.77%	1'645'705.63	0.12	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'487	0	0	2'487 USD	96.00%	2'025'691.34	0.15	a)
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	2'760	0	0	2'760 USD	90.17%	2'111'574.75	0.16	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	3'102	0	0	3'102 USD	95.73%	2'519'625.39	0.19	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	3'400	0	0	3'400 USD	95.47%	2'754'015.67	0.20	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	2'323	0	0	2'323 USD	90.28%	1'779'397.71	0.13	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	6'172	0	0	6'172 USD	84.06%	4'402'044.95	0.32	a)
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	2'737	0	0	2'737 USD	90.44%	2'100'146.55	0.15	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'800	0	0	2'800 USD	95.34%	2'265'043.33	0.17	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	3'232	0	0	3'232 USD	90.22%	2'473'969.90	0.18	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	3'297	0	0	3'297 USD	95.11%	2'660'532.40	0.20	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	3'348	0	0	3'348 USD	94.88%	2'695'029.31	0.20	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	3'659	0	0	3'659 USD	90.38%	2'805'672.49	0.21	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	5'845	0	0	5'845 USD	85.02%	4'216'086.34	0.31	a)
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'452	0	0	3'452 USD	91.38%	2'676'236.14	0.20	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'429	0	0	3'429 USD	94.80%	2'757'958.86	0.20	a)
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	3'055	0	0	3'055 USD	91.59%	2'373'890.37	0.17	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	3'202	0	0	3'202 USD	94.97%	2'580'051.08	0.19	a)
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	3'114	0	0	3'114 USD	94.75%	2'503'364.45	0.18	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	3'424	0	0	3'424 USD	91.42%	2'655'890.45	0.20	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	5'528	0	0	5'528 USD	87.16%	4'087'829.98	0.30	a)
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	3'470	0	0	3'470 USD	91.25%	2'686'510.87	0.20	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	3'287	0	0	3'287 USD	94.55%	2'636'775.54	0.19	a)
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	3'200	0	0	3'200 USD	91.08%	2'472'807.39	0.18	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'850	0	0	2'850 USD	94.58%	2'286'976.97	0.17	a)
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'600	0	0	2'600 USD	93.91%	2'071'543.70	0.15	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	3'339	0	0	3'339 USD	90.02%	2'550'119.60	0.19	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	6'373	0	0	6'373 USD	84.41%	4'563'990.99	0.34	a)
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	3'103	0	0	3'103 USD	90.30%	2'377'282.40	0.18	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	3'415	0	0	3'415 USD	93.94%	2'721'798.44	0.20	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	3'435	0	0	3'435 USD	90.59%	2'640'287.58	0.19	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	3'254	0	0	3'254 USD	94.02%	2'595'636.16	0.19	a)
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	3'250	0	0	3'250 USD	90.88%	2'505'844.05	0.18	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	2'904	0	0	2'904 USD	94.30%	2'323'379.70	0.17	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	5'932	0	0	5'932 USD	84.66%	4'260'753.63	0.31	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	3'291	0	0	3'291 USD	94.39%	2'635'621.09	0.19	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	3'251	0	0	3'251 USD	91.22%	2'516'096.77	0.19	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	3'131	0	0	3'131 USD	90.58%	2'406'205.00	0.18	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	2'916	0	0	2'916 USD	94.27%	2'332'207.04	0.17	a)
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	2'901	0	0	2'901 USD	91.89%	2'261'752.95	0.17	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	5'851	0	0	5'851 USD	87.34%	4'335'989.14	0.32	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	2'839	0	2'839	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	2'715	0	0	2'715 USD	92.30%	2'125'940.55	0.16	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'800	0	0	2'800 USD	95.38%	2'265'785.73	0.17	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	2'252	0	2'252	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'491	0	0	2'491 USD	94.22%	1'991'302.87	0.15	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	2'760	0	0	2'760 USD	96.80%	2'266'713.84	0.17	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	2'499	0	0	2'499 USD	96.25%	2'040'766.18	0.15	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	2'775	0	0	2'775 USD	97.30%	2'290'805.17	0.17	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	5'498	0	0	5'498 USD	93.56%	4'364'483.01	0.32	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CES61	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	2'374	0	0	2'374 USD	95.66%	1'926'727.61	0.14	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	2'514	0	0	2'514 USD	96.91%	2'067'013.51	0.15	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	2'535	0	0	2'535 USD	98.71%	2'123'011.31	0.16	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	2'252	0	0	2'252 USD	97.75%	1'867'718.44	0.14	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	2'599	0	0	2'599 USD	98.53%	2'172'733.83	0.16	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	2'458	0	0	2'458 USD	98.77%	2'059'910.27	0.15	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 CHF	in % 7)	Kat.
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	2'626	0	0	2'626 USD	97.09%	2'163'277.59	0.16	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	2'171	0	0	2'171 USD	94.97%	1'749'310.08	0.13	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	2'431	0	0	2'431 USD	98.78%	2'037'444.23	0.15	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	5'588	0	0	5'588 USD	92.47%	4'384'071.60	0.32	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	2'515	0	0	2'515 USD	98.11%	2'093'508.72	0.15	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	1'815	0	0	1'815 USD	97.16%	1'496'144.80	0.11	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	1'893	0	0	1'893 USD	99.11%	1'591'811.46	0.12	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	1'990	0	0	1'990 USD	100.53%	1'697'385.21	0.13	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	2'304	0	0	2'304 USD	101.00%	1'974'377.09	0.15	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	2'147	0	0	2'147 USD	99.92%	1'820'199.10	0.13	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	1'920	0	0	1'920 USD	101.09%	1'646'841.45	0.12	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	2'392	0	0	2'392 USD	100.97%	2'049'153.11	0.15	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	5'388	0	0	5'388 USD	101.88%	4'657'163.26	0.34	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	1'487	0	0	1'487 USD	100.27%	1'264'996.33	0.09	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	1'913	0	0	1'913 USD	100.53%	1'631'707.49	0.12	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	2'058	0	0	2'058 USD	100.25%	1'750'475.38	0.13	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	1'481	0	0	1'481 USD	99.72%	1'253'020.39	0.09	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	1'955	0	0	1'955 USD	100.50%	1'667'013.35	0.12	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	2'317	0	0	2'317 USD	100.33%	1'972'309.03	0.15	a)
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	1'866	0	0	1'866 USD	99.61%	1'577'023.37	0.12	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	1'957	0	1'957	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	2'494	0	0	2'494 USD	99.09%	2'096'857.74	0.15	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	1'907	0	0	1'907 USD	98.66%	1'596'252.36	0.12	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	2'139	0	0	2'139 USD	99.83%	1'811'715.22	0.13	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	5'387	0	0	5'387 USD	97.28%	4'446'336.96	0.33	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	2'343	0	0	2'343 USD	100.73%	2'002'517.22	0.15	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	1'990	0	0	1'990 USD	101.13%	1'707'410.17	0.13	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	2'239	0	0	2'239 USD	100.78%	1'914'520.80	0.14	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	1'993	0	0	1'993 USD	99.22%	1'677'750.22	0.12	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	2'395	0	0	2'395 USD	99.55%	2'022'830.18	0.15	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	2'449	0	0	2'449 USD	99.52%	2'067'789.34	0.15	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	2'390	0	2'390	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	1'950	0	0	1'950 USD	98.59%	1'631'211.41	0.12	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	2'200	0	0	2'200 USD	99.09%	1'849'674.03	0.14	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	1'900	0	0	1'900 USD	99.33%	1'601'223.92	0.12	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	5'361	0	0	5'361 USD	96.22%	4'376'548.77	0.32	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	2'520	0	0	2'520 USD	99.50%	2'127'403.53	0.16	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	1'695	0	0	1'695 USD	99.84%	1'435'875.68	0.11	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	2'280	0	0	2'280 USD	100.22%	1'938'697.64	0.14	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	1'970	0	0	1'970 USD	99.80%	1'668'051.46	0.12	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	2'450	0	0	2'450 USD	100.84%	2'096'241.56	0.15	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	2'200	0	0	2'200 USD	100.09%	1'868'194.11	0.14	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	2'200	0	0	2'200 USD	100.92%	1'883'797.72	0.14	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	2'500	0	0	2'500 USD	100.25%	2'126'427.81	0.16	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	2'390	0	0	2'390 USD	101.31%	2'054'410.32	0.15	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	1'950	0	0	1'950 USD	101.11%	1'672'831.94	0.12	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	6'085	0	0	6'085 USD	99.80%	5'152'331.54	0.38	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	100.80%	1'710'422.26	0.13	a)
US91282CHV63	5.0000 % T 5 08/31/25	2'000	0	0	2'000 USD	100.56%	1'706'445.06	0.13	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	1'900	0	0	1'900 USD	101.81%	1'641'273.50	0.12	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	2'610	0	0	2'610 USD	102.27%	2'264'625.62	0.17	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	2'500	0	0	2'500 USD	101.34%	2'149'627.62	0.16	a)
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	2'144	0	0	2'144 USD	104.47%	1'900'366.79	0.14	a)
US91282CJA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	2'762	0	0	2'762 USD	103.23%	2'419'213.98	0.18	a)
US91282CJB81	5.0000 % T 5 09/30/25	2'706	0	0	2'706 USD	100.67%	2'311'331.43	0.17	a)
US91282CJC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	2'500	0	0	2'500 USD	101.44%	2'151'616.17	0.16	a)
US91282CJE21	5.0000 % T 5 10/31/25	2'800	0	0	2'800 USD	100.77%	2'393'848.53	0.18	a)
US91282CJF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	2'550	0	0	2'550 USD	104.25%	2'255'498.27	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 CHF	in % 7)	Kat.
US91282CJG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	2'100	0	0	2'100 USD	105.91%	1'886'979.31	0.14	a)
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	5'901	0	0	5'901 USD	104.56%	5'235'134.30	0.39	a)
US91282CJL80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	2'800	0	0	2'800 USD	101.52%	2'411'665.98	0.18	a)
US91282CJL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	550	0	0	550 USD	100.73%	470'074.47	0.03	a)
US91282CJM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	2'320	0	0	2'320 USD	103.16%	2'030'531.75	0.15	a)
US91282CJN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	2'962	0	0	2'962 USD	102.41%	2'573'580.59	0.19	a)
US91282CJP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	2'100	0	0	2'100 USD	101.08%	1'800'954.35	0.13	a)
US91282CJQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	1'300	600	0	1'900 USD	99.72%	1'607'521.10	0.12	a)
US91282CJR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	1'500	1'600	0	3'100 USD	99.98%	2'629'784.16	0.19	a)
US91282CJS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	3'150	0	0	3'150 USD	100.05%	2'673'870.42	0.20	a)
US91282CJT99	4.0000 % T 4 01/15/27	700	1'000	0	1'700 USD	100.30%	1'446'647.09	0.11	a)
US91282CJV46	4.2500 % T 4 1/4 01/31/26	1'200	700	0	1'900 USD	100.13%	1'614'070.07	0.12	a)
US91282CJW29	4.0000 % T 4 01/31/29	3'250	0	0	3'250 USD	101.03%	2'785'898.84	0.21	a)
US91282CJX02	4.0000 % T 4 01/31/31	0	2'000	0	2'000 USD	101.11%	1'715'725.07	0.13	a)
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	6'435	0	6'435 USD	100.64%	5'494'752.17	0.40	a)
US91282CKA89	4.1250 % T 4 1/8 02/15/27	0	2'500	0	2'500 USD	100.61%	2'134'050.71	0.16	a)
US91282CKB62	4.6250 % T 4 5/8 02/28/26	0	1'400	0	1'400 USD	100.72%	1'196'367.53	0.09	a)
US91282CKC46	4.2500 % T 4 1/4 02/28/31	0	2'200	0	2'200 USD	102.55%	1'914'129.81	0.14	a)
US91282CKD29	4.2500 % T 4 1/4 02/28/29	0	3'300	0	3'300 USD	102.13%	2'859'382.56	0.21	a)
US91282CKE02	4.2500 % T 4 1/4 03/15/27	0	1'800	0	1'800 USD	101.02%	1'542'720.65	0.11	a)
US91282CKF76	4.1250 % T 4 1/8 03/31/31	0	2'300	0	2'300 USD	101.84%	1'987'414.58	0.15	a)
US91282CKG59	4.1250 % T 4 1/8 03/31/29	0	3'500	0	3'500 USD	101.58%	3'016'438.46	0.22	a)
US91282CKH33	4.5000 % T 4 1/2 03/31/26	0	2'700	0	2'700 USD	100.63%	2'305'132.59	0.17	a)
US91282CKJ98	4.5000 % T 4 1/2 04/15/27	0	3'000	0	3'000 USD	101.66%	2'587'507.36	0.19	a)
US91282CKK61	4.8750 % T 4 7/8 04/30/26	0	3'700	0	3'700 USD	101.30%	3'179'977.50	0.23	a)
US91282CKN01	4.6250 % T 4 5/8 04/30/31	0	2'400	0	2'400 USD	104.77%	2'133'321.37	0.16	a)
US91282CKP58	4.6250 % T 4 5/8 04/30/29	0	3'500	0	3'500 USD	103.73%	3'080'470.21	0.23	a)
US91282CKQ32	4.3750 % T 4 3/8 05/15/34	0	6'036	0	6'036 USD	103.64%	5'307'689.24	0.39	a)
US91282CKR15	4.5000 % T 4 1/2 05/15/27	0	2'800	0	2'800 USD	101.69%	2'415'749.26	0.18	a)
US91282CKS97	4.8750 % T 4 7/8 05/31/26	0	3'700	0	3'700 USD	101.41%	3'183'410.91	0.23	a)
US91282CKT70	4.5000 % T 4 1/2 05/31/29	0	3'300	0	3'300 USD	103.31%	2'892'631.19	0.21	a)
US91282CKU44	4.6250 % T 4 5/8 05/31/31	0	2'300	0	2'300 USD	104.78%	2'044'737.99	0.15	a)
US91282CKV27	4.6250 % T 4 5/8 06/15/27	0	3'000	0	3'000 USD	102.16%	2'600'234.11	0.19	a)
US91282CKW00	4.2500 % T 4 1/4 06/30/31	0	1'100	0	1'100 USD	102.64%	957'939.77	0.07	a)
US91282CKX82	4.2500 % T 4 1/4 06/30/29	0	2'700	0	2'700 USD	102.22%	2'341'642.46	0.17	a)
US91282CLC37	4.0000 % T 4 07/31/29	0	3'600	0	3'600 USD	101.19%	3'090'691.24	0.23	a)
US91282CLD10	4.1250 % T 4 1/8 07/31/31	0	2'300	0	2'300 USD	101.89%	1'988'329.22	0.15	a)
USD							554'491'001.76	40.85	
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							628'483'265.67	46.30	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							628'483'265.67	46.30	
CH0302469082	SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVT. ST	251	14	13	253 AUD	107'393.50	15'623'187.89	1.15	a)
AUD							15'623'187.89	1.15	
CH0302468589	SWC (CH) INDEX BF CANADA GOVT. ST	351	20	9	362 CAD	102'187.39	23'271'928.77	1.71	a)
CAD							23'271'928.77	1.71	
CH0302469108	SWC (CH) INDEX BF WORLD REST GOVT. ST CHF	445	27	14	457 CHF	86'933.22	39'747'518.63	2.93	a)
CHF							39'747'518.63	2.93	
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	717'943	217'474	4'738	930'679 CNY	1'121.66	124'975'384.22	9.21	a)
CNY							124'975'384.22	9.21	
CH0117045150	SWC (CH) INDEX BF EMU GOVT. NT EUR	3'222'059	194'563	180'993	3'235'629 EUR	118.90	361'314'604.92	26.62	a)
EUR							361'314'604.92	26.62	
CH0302468605	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. ST GBP	610	65	26	649 GBP	87'751.10	63'550'641.24	4.68	a)
GBP							63'550'641.24	4.68	

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 CHF	in % 7)	Kat.
Derivative Finanzinstrumente							-5'892.22	0.00	
Devisentermingeschäfte									
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		1'260'000	1'131'388	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		1'260'000	1'322'439	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		6'300'000	7'155'724	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		4'900'000	823'356'991	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		10'950'000	12'159'263	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		640'000	562'580	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		12'500'000	12'851'752	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		2'780'000	2'705'087	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2024		215'000'000	1'280'678	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		4'300'000	3'874'872	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024		3'320'000	3'386'504	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.05.2024		770'000	1'293'413	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024		1'370'000	1'494'525	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024		2'100'000	2'150'919	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024		1'800'000	1'970'562	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.05.2024		1'279'248	1'170'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 29.05.2024		89'244'953	520'000	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.05.2024		524'283	520'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 29.05.2024		3'970'176	500'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CNY Verfall 05.06.2024		4'575'629	580'000	CNY/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2024		33'029'888	4'100'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.06.2024		440'857	390'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		11'574'428	10'400'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		792'332	900'000	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		3'011'329	2'900'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.07.2024		632'700	650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.07.2024		3'551'215	3'200'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.07.2024		349'104'502	1'950'000	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		6'248'679	5'500'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.08.2024		8'784'533	1'070'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 06.08.2024		3'517'293	3'250'000	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		707'596	800'000	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 27.08.2024		398'935	250'000	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.08.2024		369'497	350'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.08.2024		674'609	575'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2024		1'829'523	2'040'000	GBP/CHF		-1'016.21	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		6'655'067	6'250'000	EUR/CHF		-2'062.03	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 04.09.2024		62'389'076	7'470'000	CNY/CHF		-1'240.53	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024		489'040'097	2'850'000	JPY/CHF		116.91	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 05.09.2024		4'008'063	3'400'000	USD/CHF		-1'690.36	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							-5'892.22	0.00	
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		1'750'817	21'126'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		2'747'274	21'528'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2024		13'743'521	24'026'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		129'481'175	21'976'207'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2024		2'063'083	24'291'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		20'534'811	31'721'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.04.2024		3'438'023	13'979'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.04.2024		8'934'593	174'631'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2024		2'425'449	4'536'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.04.2024		5'455'067	24'797'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		51'673'156	46'536'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		324'438'123	341'173'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		474'046'444	540'142'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2024		4'138'507	6'332'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		14'512	113'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		54'047	83'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.04.2024		26'635	516'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		1'970'484	2'059'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2024		5'913	9'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2024		36'339	63'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2024		4'794	56'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		960'111	860'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		4'617	55'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.04.2024		11'388	46'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		2'407'327	2'729'000	CHF/USD		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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 04.04.2024		51'884'000	306'349		JPY/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2024		31'195	58'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2024		15'000	1'931		DKK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		592'860	618'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.04.2024		9'000	2'221		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.04.2024		130'000	6'725		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2024		4'000	2'631		SGD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		2'240	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		22'048	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		233'828	39'716'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2024		10'000	5'755		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.04.2024		23'000	5'102		PLN/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2024		6'934	12'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		2'603	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		46'080	48'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2024		18'000	2'319		DKK/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.04.2024		194'287	872'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.04.2024		205'304	3'952'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		18'888	3'196'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2024		115'297	214'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		6'724	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2024		384'000	32'855		SEK/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		99'987	1'193'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.04.2024		40'495	165'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		972'415	1'106'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2024		36'828	56'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		313'682	358'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2024		4'000	4'489		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2024		2'119'000	12'687		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		506'907	529'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		64'840	74'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		43'086	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		312'230	52'450'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		5'602	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2024		6'000	6'729		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		55'000	52'783		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2024		4'108'000	24'440		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		90'000	78'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		1'097'046	1'244'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.04.2024		18'000	4'029		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2024		15'000	8'715		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2024		22'000	14'356		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2024		28'000	31'484		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		113'695	19'054'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.04.2024		127'000	6'697		MXN/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		446'800	465'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		50'000	44'108		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2024		2'089'000	12'388		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		32'000	30'758		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		367'674	325'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		357'088	60'726'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		48'056	54'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		397'241	411'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		17'831	3'005'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		6'808	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		1'338'119	1'491'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		947'680	974'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		181'741	186'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		16'000	14'435		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2024		24'076'000	14'145'685		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.04.2024		178'842'000	9'689'123		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2024		47'702'000	54'272'807		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		346'421'000	336'974'792		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.04.2024		4'808'000	2'589'954		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2024		31'786'000	21'153'265		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		547'067'000	492'716'441		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2024		6'393'000	4'266'241		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2024		21'608'000	2'817'532		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.04.2024		22'374'000	1'857'120		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.04.2024		25'628'000	5'787'597		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.04.2024		14'181'000	3'486'329		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2024		23'963'000	2'018'284		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2024		22'094'154'000	131'501'334		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		88'478'578	725'371'000		CHF/CNY	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 CHF	in % 7)	Kat.
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		308'791	2'520'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		913'948	7'458'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		13'070	107'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.04.2024		70'000	8'555	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		249'106	2'040'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.04.2024		126'000	15'371	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.04.2024		404'000	49'553	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.04.2024		77'000	9'438	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		9'132	74'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		12'384	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.04.2024		736'993'000	91'390'080	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2024	21'662'697'000	126'261'029	JPY/CHF			0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.05.2024	767'891'000	97'092'138	CNY/CHF			0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.05.2024	14'237'221	24'299'000	CHF/AUD			0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024	91'060'962	735'977'000	CHF/CNY			0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 07.05.2024	9'314'539	173'469'000	CHF/MXN			0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024	53'132'810	46'864'000	CHF/GBP			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	327'793'073	337'775'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.05.2024	2'599'784	4'844'000	CHF/NZD			0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.05.2024	21'155'654	31'892'000	CHF/CAD			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	483'021'792	538'292'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 07.05.2024	4'336'557	6'513'000	CHF/SGD			0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 07.05.2024	2'835'294	21'789'000	CHF/DKK			0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 07.05.2024	1'875'620	22'662'000	CHF/NOK			0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 07.05.2024	5'875'543	26'122'000	CHF/PLN			0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.05.2024	3'509'881	14'315'000	CHF/ILS			0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 07.05.2024	2'018'617	24'024'000	CHF/SEK			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	126'793'893	21'275'107'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.05.2024	12'604	19'000	CHF/CAD			0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.05.2024	7'615	13'000	CHF/AUD			0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024	27'208	24'000	CHF/GBP			0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024	53'704	434'000	CHF/CNY			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	2'336'634	2'407'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	1'217'064	204'055'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	3'746'636	4'173'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 07.05.2024	14'720	22'000	CHF/SGD			0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 07.05.2024	79'000	10'315	DKK/CHF			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	345'855	57'772'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.05.2024	395'000	356'685	USD/CHF			0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 07.05.2024	2'392'000	199'203	NOK/CHF			0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 07.05.2024	72'000	6'076	SEK/CHF			0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024	2'401'571	19'271'000	CHF/CNY			0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.05.2024	30'905	127'000	CHF/ILS			0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 07.05.2024	10'864	48'000	CHF/PLN			0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 07.05.2024	1'814'000	98'217	MXN/CHF			0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024	211'000	205'393	EUR/CHF			0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.05.2024	39'000	25'950	CAD/CHF			0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024	70'361	62'000	CHF/GBP			0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 07.05.2024	33'916	63'000	CHF/NZD			0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.05.2024	30'613	52'000	CHF/AUD			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	35'320	36'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024	283'380	248'000	CHF/GBP			0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024	730'431	5'860'000	CHF/CNY			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	13'950	2'336'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	417'510	463'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	5'413	6'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	370'553	378'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024	273'417	2'196'000	CHF/CNY			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	460'424	511'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.05.2024	2'000	2'286	GBP/CHF			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	283'893	290'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.05.2024	60'000	7'526	CNY/CHF			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	333'400	55'794'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	275'550	303'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024	180'988	159'000	CHF/GBP			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	369'095	406'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	268'838	276'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	184'840	31'011'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	170'841	188'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	5'801	6'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024	6'642	1'124'000	CHF/JPY			0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024	25'503	28'000	CHF/USD			0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024	289'791	299'000	CHF/EUR			0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024	1'471'000	8'690	JPY/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 07.05.2024		36'000	32'802		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024		21'000	20'368		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024		6'795	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024		12'747	14'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024		23'000	22'294		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.05.2024		40'000	36'319		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.05.2024		37'000	4'636		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.05.2024		5'000	5'611		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024		530'516	583'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024		19'000	18'415		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 07.05.2024		58'000	7'281		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024		2'690'000	15'852		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.05.2024		27'000	24'550		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		233'383	39'659'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024		214'104	220'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024		542'205	4'308'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024		657'944	720'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024		4'881	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 07.05.2024		23'952'000	2'000'639		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 07.05.2024		21'710'000	2'853'997		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.05.2024		545'189'000	499'823'823		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.05.2024		24'364'000	14'506'009		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024		341'425'000	334'755'604		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 07.05.2024		171'655'000	9'231'228		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 07.05.2024		4'907'000	2'662'097		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 07.05.2024		20'270'000	1'678'397		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.05.2024		14'442'000	3'548'212		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 07.05.2024		31'872'000	21'270'257		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.05.2024		47'350'000	54'356'474		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 07.05.2024		6'535'000	4'394'036		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 07.05.2024		26'170'000	5'931'378		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.06.2024		4'560'000	2'527'380		NZD/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2024		2'002'831	24'026'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		122'692'378	21'027'584'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		485'814'028	531'652'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		98'259'386	778'798'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2024		13'359'236	22'492'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		327'382'271	334'616'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2024		8'972'222	168'193'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		2'478'725	4'584'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2024		1'643'974	19'905'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2024		3'587'240	14'636'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2024		20'890'120	31'392'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		52'673'207	46'027'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2024		4'328'369	6'450'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2024		5'585'178	24'732'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2024		20'432'000	121'278		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		190'651	1'512'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2024		205'000	16'888		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.06.2024		90'000	60'414		SGD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2024		54'201	91'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2024		426'000	95'636		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		298'000	338'853		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2024		595'000	49'709		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.06.2024		122'000	81'066		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.06.2024		2'764'000	147'841		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2024		3'291'000	3'206'402		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		3'676'000	3'346'965		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2024		17'000	9'176		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		172'000	42'086		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		822'402	6'562'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2024		5'606	67'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		3'315	564'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		32'549	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2024		2'007	3'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2024		126'000	28'518		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		39'000	9'547		ILS/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2024		28'559	535'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2024		17'000	9'252		NZD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		7'804	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2024		75'000	6'240		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2024		142'000	17'814		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2024		46'000	44'828		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		5'000	5'659		GBP/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 05.06.2024		3'031'000	17'706		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		75'000	67'932		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		44'124	7'573'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		15'852	14'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		2'228'836	2'462'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		39'112	312'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		1'635'387	1'677'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2024		553'024	836'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2024		206'000	123'390		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		15'641	16'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		443'000	503'246		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		14'465	16'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2024		124'052	207'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		5'504	44'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2024		79'970	349'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		506'534	445'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2024		51'545	77'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		37'115	68'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2024		69'766	285'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2024		30'369	363'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		16'000	14'467		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		6'715	1'158'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2024		164'350	248'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2024		123'154	2'303'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2024		44'832	536'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		235'898	40'467'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2024		323'000	27'171		NOK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		380'602	388'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2024		160'000	96'340		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		189'655	1'515'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.06.2024		1'972'000	106'260		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.06.2024		64'000	42'938		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		256'000	63'011		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		192'000	173'350		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		532'000	607'656		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2024		489'000	41'247		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2024		300'000	68'988		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2024		58'000	31'881		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.06.2024		993'000	657'958		CAD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		673'454	115'586'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		896'889	784'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		24'274	194'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		1'274'991	1'412'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		80'526	82'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		482'972	82'707'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		883'306	7'042'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		1'659'749	1'684'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		391'205	432'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2024		7'323	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		5'750	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2024		4'847	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2024		3'418'000	19'979		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		372'610	408'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		308'863	312'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2024		122'000	15'376		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		7'000	8'135		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		608'882	667'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		530'920	537'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		468'937	3'724'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		1'141'292	1'249'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		474'978	408'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		535'319	540'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		499'232	85'658'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		3'486	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		34'559	38'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		23'741	24'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2024		7'142	57'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		8'979	1'547'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2024		1'902'000	11'030		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2024		69'000	8'664		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2024		29'000	28'627		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		46'000	41'983		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2024		24'229'000	5'551'106		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		46'401'000	53'293'405		GBP/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/MXN Verfall 05.06.2024		166'295'000	8'794'761		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2024		799'427'000	99'224'879		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.06.2024		31'372'000	20'761'362		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2024		19'665'000	1'689'047		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2024		21'334'061'000	122'488'231		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2024		336'518'000	329'585'729		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		14'454'000	3'505'240		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2024		22'432'000	13'456'800		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		534'367'000	482'052'471		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2024		23'545'000	2'019'855		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.06.2024		6'376'000	4'255'106		SGD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.06.2024		2'779'904	21'187'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.06.2024		538'000	70'307		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.06.2024		65'000	8'504		DKK/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.06.2024		40'439	308'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.06.2024		267'000	35'110		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.06.2024		20'625'000	2'707'980		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		31'950'000	20'978'945		CAD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		2'566'274	4'645'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.07.2024		5'788'065	25'354'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		53'259'292	46'513'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.07.2024		9'071'156	172'858'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		103'779'844	837'103'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		20'908'684	31'678'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.07.2024		1'704'379	19'894'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		120'117'769	20'899'097'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		327'441'308	334'991'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.07.2024		2'699'109	20'591'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		3'268'988	13'510'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.07.2024		13'445'376	22'467'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		485'653'964	540'095'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.07.2024		1'706'078	19'925'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.07.2024		4'355'458	6'539'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		13'803	25'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.07.2024		25'759	508'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		41'181'000	236'698		JPY/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.07.2024		3'985	6'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.07.2024		4'097	48'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.07.2024		17'011	75'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		588'525	605'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		5'430'935	6'076'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		120'060	183'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		1'526'704	1'337'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		970'524	7'859'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.07.2024		5'376	9'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.07.2024		6'393	49'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		462'784	80'782'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		5'170	42'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		32'999	37'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		22'317	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		52'000	6'417		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		372'352	416'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		1'291'000	7'389		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		414'522	431'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		407'295	423'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		409'129	456'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.07.2024		1'786	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		1'001'880	1'127'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		579'079	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		119'520	184'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		239'776	1'953'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		488'163	85'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		125'578	110'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		113'596	175'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.07.2024		9'395	110'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		14'318	26'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		11'000	12'536		GBP/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.07.2024		23'829	36'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		18'016	75'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.07.2024		45'539	950'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		164'000	20'177		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		28'222'000	160'925		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		42'000	40'414		EUR/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.07.2024		9'238	110'000		CHF/NOK	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 CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 03.07.2024		14'578	113'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		276'000	246'358	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.07.2024		72'933	123'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.07.2024		30'956	140'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		12'385	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		15'293	125'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		25'035	4'440'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		958'337	1'008'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		1'641'785	1'847'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		357'000	403'260	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		159'127'000	899'701	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		7'749'000	950'430	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		6'537'000	5'822'826	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		3'897'000	3'722'726	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		64'000	7'782	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		338'290	383'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		970'000	5'435	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		10'000	9'492	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		14'309	15'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		4'640	38'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		382'442	430'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		5'077	905'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		40'000	4'901	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		16'000	15'263	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		26'000	23'210	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		1'038'000	5'814	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		965'322	1'080'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.07.2024		13'615	111'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		15'264	2'725'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		6'795	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		595'107	622'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		20'000	22'638	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		1'145'000	1'096'902	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		2'755'000	2'470'034	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		8'901'000	49'730	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.07.2024		256'000	167'620	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		359'000	44'131	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		97'000	93'199	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		6'319'000	35'299	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		14'000	15'882	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		162'000	145'286	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.07.2024		14'000	9'173	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.07.2024		16'000	9'555	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		253'000	31'086	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.07.2024		127'000	6'197	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.07.2024		20'035'000	1'699'674	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.07.2024		838'550'000	103'200'349	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.07.2024		20'753'000	2'679'690	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		20'826'200'000	116'337'236	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.07.2024		4'696'000	2'570'905	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.07.2024		13'585'000	3'240'294	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		47'575'000	54'034'163	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.07.2024		22'586'000	13'552'503	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.07.2024		174'189'000	8'558'463	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.07.2024		20'052'000	1'692'068	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		333'511'000	321'147'747	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.07.2024		6'581'000	4'363'525	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.07.2024		25'569'000	5'714'467	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		542'191'000	487'132'859	USD/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.08.2024		1'731'542	20'461'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		109'249'967	889'216'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.08.2024		2'822'498	21'907'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		116'560'756	20'844'459'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		21'188'221	32'377'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.08.2024		2'680'282	4'916'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.08.2024		3'324'360	13'978'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		55'660'698	49'199'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		13'589'241	22'720'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		8'257'654	169'669'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.08.2024		1'722'784	20'483'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		324'706'914	338'061'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.08.2024		4'191'636	6'338'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		5'898'602	26'512'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		502'115'699	561'178'000	CHF/USD		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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 06.08.2024		65'000	8'437	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.08.2024		7'000	3'826	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.08.2024		9'000	2'017	PLN/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.08.2024		19'261	29'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		67'950	550'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		204'000	232'305	GBP/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		17'406	358'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		1'351'000	1'216'482	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		182'881	189'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		50'000	32'813	CAD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		90'492	151'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		778'552	139'086'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		1'877'537	335'825'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		15'156	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		41'248	36'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		9'661	16'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		6'206	126'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		80'717	655'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		3'298'923	3'675'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		5'185'926	5'339'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.08.2024		10'154	119'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		470'618	780'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		2'141'396	17'411'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		472'911	720'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		34'782	154'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.08.2024		10'081	119'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		6'035'887	6'744'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.08.2024		24'558	37'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		48'765	994'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		994'174	1'025'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.08.2024		16'517	127'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		1'137'439	993'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.08.2024		19'644	81'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		555'209	99'450'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.08.2024		15'366	28'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.08.2024		19'000	2'472	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.08.2024		18'000	1'522	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.08.2024		3'000	1'647	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		71'000	81'481	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		116'029	944'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		13'884	23'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		121'158	21'677'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		925'000	897'307	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.08.2024		5'000	3'320	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		197'000	129'324	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.08.2024		12'000	2'925	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.08.2024		18'000	1'528	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		633'000	565'996	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.08.2024		23'000	5'222	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.08.2024		157'000	7'776	MXN/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		878'904	907'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.08.2024		6'341	26'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		151'651	231'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		5'369	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		140'888	123'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		16'627	335'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.08.2024		7'295	11'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.08.2024		5'327	41'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		11'354	50'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.08.2024		10'000	6'656	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.08.2024		40'000	5'213	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.08.2024		48'000	10'939	PLN/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		5'034	904'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		4'681	38'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.08.2024		327'000	16'374	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.08.2024		25'000	6'132	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		329'000	319'741	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		229'000	150'887	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		120'000	138'093	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		563'212	628'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		389'159	594'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		946'482	975'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		11'394	50'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.08.2024		6'647	10'000	CHF/SGD		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 CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		982'387	1'102'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		142'869	124'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.08.2024		6'369	26'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		256'715	5'150'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.08.2024		5'336	41'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.08.2024		39'000	5'093	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		119'000	137'910	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.08.2024		396'000	19'895	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		329'823	2'684'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		10'552	1'860'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.08.2024		47'000	10'746	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.08.2024		9'000	5'994	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.08.2024		24'000	5'931	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		232'000	152'002	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		331'000	322'453	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		332'736	373'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		20'132	403'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		337'601	346'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		139'134	120'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		152'404	233'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		11'003	48'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.08.2024		1'899'000	10'774	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		344'000	334'888	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		10'293	1'821'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		120'000	138'921	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		233'000	152'137	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.08.2024		401'000	20'199	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.08.2024		47'000	10'673	PLN/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		713'783	807'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		229'310	40'463'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		142'710	124'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		20'625	415'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		11'024	49'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		151'891	235'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		988'873	1'022'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		231'000	149'015	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		12'355	14'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		11'996	2'126'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		119'000	136'323	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		331'000	319'104	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		10'691	88'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		16'409	73'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		151'914	235'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.08.2024		10'105	78'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		309'312	320'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		445'272	502'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		154'684	135'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		26'689	219'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.08.2024		58'400	110'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.08.2024		123'024	545'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.08.2024		99'684	151'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		278'849	314'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.08.2024		94'693	387'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.08.2024		164'882	3'335'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.08.2024		36'808	455'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		185'709	192'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.08.2024		20'710	250'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.08.2024		47'445	366'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		18'212	19'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		27'362	31'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.08.2024		119'107	979'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		364'118	380'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		608'817	690'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		470'000	450'371	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		710'000	628'868	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		346'045'000	329'584'677	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.08.2024		27'307'000	6'056'611	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.08.2024		179'504'000	8'478'943	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.08.2024		14'437'000	3'379'131	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.08.2024		22'397'000	2'858'641	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.08.2024		912'784'000	111'163'399	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.08.2024		21'485'772'000	125'698'212	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		33'476'000	21'329'568	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.08.2024		5'044'000	2'636'711	NZD/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SGD Verfall 06.08.2024		6'552'000	4'311'419	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.08.2024		20'812'000	1'709'012	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		50'101'000	56'637'577	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.08.2024		23'690'000	13'616'301	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.08.2024		21'039'000	1'693'303	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		573'370'000	504'626'377	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		332'685'724	350'068'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.09.2024		5'696'371	25'785'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2024		8'672'743	185'171'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2024		3'486'256	14'925'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2024		2'902'745	22'787'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2024		115'496'813	949'864'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		126'557'765	21'614'593'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2024		21'684'364	34'127'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2024		2'734'141	5'249'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2024		4'428'625	6'745'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2024		1'732'131	21'139'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		58'012'771	51'487'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2024		13'659'597	23'832'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2024		1'710'871	21'319'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		519'228'304	592'089'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		270'886	247'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.09.2024		25'261	116'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2024		26'041	582'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2024		82'236	133'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2024		695'545	5'791'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		972'856	1'039'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		3'416'567	3'991'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024		117'550'000	689'325	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2024		148'577	266'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2024		9'711	19'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2024		10'417	83'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2024		20'062	31'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024		9'001'000	53'650	JPY/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2024		344'800	629'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2024		249'000	210'666	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.09.2024		399'000	47'780	CNY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		354'148	328'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2024		146'000	135'806	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2024		437'000	479'590	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.09.2024		5'732'000	690'643	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024		75'106'000	441'337	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.09.2024		507'000	286'898	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.09.2024		308'000	193'650	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2024		763'000	720'346	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2024		1'744'000	1'504'224	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2024		61'000	52'610	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024		3'349'000	19'685	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2024		1'399'000	1'317'514	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		413'133	373'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		18'076	19'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		27'562	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2024		409'749	651'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2024		185'879	1'535'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		271'037	46'170'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2024		370'161	641'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		3'436'989	4'016'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		1'300'447	220'786'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2024		12'562	20'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2024		1'300'470	10'814'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		623'405	559'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		3'388'099	3'561'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.09.2024		11'260	51'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		559'242	657'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		10'837	1'859'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2024		9'936	227'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2024		12'552	24'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2024		227'914	364'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		345'507	365'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.09.2024		627'000	394'737	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2024		30'737	257'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2024		180'000	169'059	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.09.2024		89'000	19'498	PLN/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2024		7'491	13'000	CHF/AUD		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 CHF	in % 7)	Kat.
	NZD/CHF Verfall 05.09.2024		128'962	243'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.09.2024		78'000	9'823		DKK/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		15'625	14'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.09.2024		73'000	5'893		NOK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		33'835	5'797'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.09.2024		624'000	26'641		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.09.2024		72'000	5'962		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2024		1'060'000	899'211		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.09.2024		51'000	11'825		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.09.2024		23'000	14'971		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2024		52'571'000	58'606'466		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.09.2024		5'535'000	2'937'375		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.09.2024		25'863'000	5'680'032		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.09.2024		24'874'000	14'315'982		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.09.2024		14'874'000	3'478'441		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.09.2024		6'753'000	4'395'052		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.09.2024		21'067'000	1'744'980		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.09.2024		34'360'000	21'625'875		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024	21'684'199'000	126'356'928			JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.09.2024	962'130'000	115'178'478			CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2024	352'564'000	331'045'609			EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.09.2024	185'356'000	8'003'301			MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.09.2024	22'792'000	2'869'194			DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.09.2024	21'246'000	1'701'284			NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2024	597'671'000	506'950'519			USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2024	60'557'070	54'487'000			CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 03.10.2024	2'957'477	5'591'000			CHF/NZD	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 03.10.2024	5'679'147	25'956'000			CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.10.2024	14'519'490	25'294'000			CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 03.10.2024	4'438'271	6'831'000			CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 03.10.2024	1'749'424	21'160'000			CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 03.10.2024	21'722'977	34'598'000			CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.10.2024	131'159'671	22'491'661'000			CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.10.2024	337'050'610	359'691'000			CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 03.10.2024	8'019'342	187'171'000			CHF/MXN	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 03.10.2024	2'886'240	22'967'000			CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 03.10.2024	1'720'040	21'539'000			CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.10.2024	516'913'210	611'440'000			CHF/USD	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 07.10.2024	3'494'397	14'985'000			CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 09.10.2024	122'310'852	1'022'495'000			CHF/CNY	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	27'270'353.66	2.01
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	693'208'187.53	51.07
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	628'483'265.67	46.30
Derivative Finanzinstrumente	-5'892.22	0.00
Sonstige Vermögenswerte	8'502'920.68	0.63
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'357'458'835.32	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-35'269.38	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'357'423'565.94	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'321'691'453.20	97.37
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-5'892.22	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	Kurswert CHF	in % 7)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	177'422'253.34	13.07
US912810QS06 3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	681 USD 94.59%	546'557.44 0.04
US912810QY73 2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	1'145 USD 80.33%	780'367.80 0.06

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'638 USD	81.31%	1'130'049.49	0.08
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	469 USD	83.75%	333'260.55	0.02
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	450 USD	81.44%	310'930.41	0.02
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'721 USD	76.63%	1'118'864.80	0.08
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'762 USD	76.45%	1'142'950.36	0.08
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	2'084 USD	79.94%	1'413'430.73	0.10
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	1'850 USD	79.72%	1'251'291.41	0.09
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	2'000 USD	85.22%	1'446'076.97	0.11
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'398 USD	79.56%	1'618'765.18	0.12
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	1'397 USD	52.53%	622'644.84	0.05
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	3'500 USD	54.16%	1'608'210.46	0.12
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	1'774 USD	64.13%	965'177.63	0.07
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	2'311 USD	64.66%	1'267'759.03	0.09
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	3'500 USD	61.67%	1'831'392.73	0.13
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	1'500 USD	71.84%	914'337.45	0.07
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'500 USD	75.98%	1'611'723.68	0.12
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'500 USD	63.38%	1'881'968.16	0.14
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'900 USD	61.33%	2'029'319.89	0.15
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'430 USD	67.28%	1'958'007.84	0.14
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	2'521 USD	76.38%	1'633'617.30	0.12
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	3'413 USD	77.27%	2'237'426.80	0.16
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	2'155 USD	87.11%	1'592'716.40	0.12
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	1'909 USD	96.47%	1'562'495.71	0.12
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	2'800 USD	100.41%	2'385'311.12	0.18
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	500 USD	95.38%	404'604.59	0.03
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	2'700 USD	96.63%	2'213'499.99	0.16
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	3'590 USD	96.89%	2'951'225.79	0.22
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'000 USD	96.72%	2'461'830.70	0.18
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	3'200 USD	97.48%	2'646'739.91	0.19
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	3'300 USD	95.38%	2'670'390.32	0.20
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'000 USD	94.09%	1'596'676.84	0.12
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	1'800 USD	96.50%	1'473'757.65	0.11
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	2'700 USD	96.03%	2'199'898.28	0.16
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'530 USD	96.25%	2'066'081.81	0.15
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	2'800 USD	94.63%	2'247'968.28	0.17
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'900 USD	91.66%	1'477'549.16	0.11
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	4'421 USD	84.00%	3'150'837.86	0.23
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	2'209 USD	96.59%	1'810'385.23	0.13
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	2'400 USD	90.63%	1'845'378.75	0.14
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'220 USD	96.00%	1'808'216.64	0.13
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	2'700 USD	90.17%	2'065'670.95	0.15
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	2'900 USD	95.47%	2'349'013.37	0.17
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	2'323 USD	90.28%	1'779'397.71	0.13
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	5'817 USD	84.06%	4'148'848.92	0.31
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'800 USD	95.34%	2'265'043.33	0.17
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	3'330 USD	94.88%	2'680'539.90	0.20
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	2'900 USD	90.38%	2'223'681.39	0.16
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	5'000 USD	85.02%	3'606'575.14	0.27
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'152 USD	91.38%	2'443'654.78	0.18
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'400 USD	94.80%	2'734'634.04	0.20
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	62 USD	94.97%	49'957.27	0.00
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	4'790 USD	87.16%	3'542'095.81	0.26
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	3'200 USD	91.08%	2'472'807.39	0.18
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'100 USD	93.91%	1'673'169.91	0.12
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	3'301 USD	90.02%	2'521'097.58	0.19
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	6'000 USD	84.41%	4'296'868.97	0.32
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	3'100 USD	90.30%	2'374'984.02	0.17
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	2'915 USD	93.94%	2'323'292.08	0.17
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	3'435 USD	90.59%	2'640'287.58	0.19
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	3'100 USD	90.88%	2'390'189.71	0.18
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	1'928 USD	94.30%	1'542'519.30	0.11

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	532 USD	84.66%	382'117.49	0.03	
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	2'941 USD	94.39%	2'355'321.07	0.17	
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	5'851 USD	87.34%	4'335'989.14	0.32	
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'200 USD	95.38%	1'780'260.21	0.13	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'350 USD	94.22%	1'878'587.62	0.14	
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	2'700 USD	96.80%	2'217'437.45	0.16	
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	1'500 USD	97.30%	1'238'273.07	0.09	
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	2'514 USD	96.91%	2'067'013.51	0.15	
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	1'309 USD	98.71%	1'096'261.07	0.08	
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	2'000 USD	98.53%	1'671'976.78	0.12	
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	2'458 USD	98.77%	2'059'910.27	0.15	
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	5'288 USD	92.47%	4'148'706.27	0.31	
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	2'115 USD	98.11%	1'760'545.11	0.13	
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	1'750 USD	100.53%	1'492'675.44	0.11	
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	2'104 USD	101.00%	1'802'990.19	0.13	
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	3'142 USD	101.88%	2'715'814.21	0.20	
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	1'000 USD	100.27%	850'703.65	0.06	
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	1'772 USD	100.50%	1'510'970.67	0.11	
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	5'380 USD	97.28%	4'440'559.28	0.33	
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	1'793 USD	99.22%	1'509'385.92	0.11	
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	2'200 USD	100.09%	1'868'194.11	0.14	
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	1'300 USD	100.25%	1'105'742.46	0.08	
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	2'390 USD	101.31%	2'054'410.32	0.15	
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	5'600 USD	99.80%	4'741'669.12	0.35	
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	4'500 USD	104.56%	3'992'222.39	0.29	
US91282CJS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	1'800 USD	100.05%	1'527'925.96	0.11	
US91282CKH33	4.5000 % T 4 1/2 03/31/26	351 USD	100.63%	299'667.24	0.02	
US91282CLD10	4.1250 % T 4 1/8 07/31/31	200 USD	101.89%	172'898.19	0.01	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57567333
CAD	1 = CHF	0.62953070
CNY	1 = CHF	0.11971920
DKK	100 = CHF	12.59089400
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
ILS	1 = CHF	0.23389387
JPY	100 = CHF	0.58270700
MXN	1 = CHF	0.04319021
NOK	100 = CHF	8.01014000
NZD	1 = CHF	0.53083274
PLN	1 = CHF	0.21968618
SEK	100 = CHF	8.28503800
SGD	1 = CHF	0.65092639
USD	1 = CHF	0.84845000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	7'931'160.80	4.114
Bond	CHF	183'371'600.05	95.106
Equity	CHF	835'576.99	0.433
Index bond	CHF	669'719.95	0.347
Total	CHF	192'808'057.79	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	22'009'667.42	1.621
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'238'228'334.34	91.219

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA CHF	CHF	0.00 - 0.06	-	0.042	0.00 - 0.01	-	-
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.06	-	0.042	0.00 - 0.01	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.06	-	0.042	0.00 - 0.01	-	-
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.06	-	0.042	0.00 - 0.01	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.06	-	0.042	0.00 - 0.01	-	-
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.06	-	0.042	0.00 - 0.01	-	-

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	177'422'253.34
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds
	Eff	Max			Eff
FA CHF	0.180	0.500	0.130	0.050	3.000
FAH1 CHF	0.200	0.550	0.150	0.050	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
GTH1 CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

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

9 Benchmark

FTSE Non-CHF World Government Bond Index

10 TER

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

11 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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